

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGAJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
ABSTRACT.....	v
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GRAFIK.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
DAFTAR SINGKATAN	xviii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	9
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Kegunaan Peneliti	10
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori dan Kajian Empiris.....	11
2.1.1Pengertian Pasar Modal.....	11
2.1.2Indeks Harga Saham Gabungan	12
2.1.3 Jakarta Islamic Index (JII).....	14
2.1.4 Saham Syariah.....	16
2.1.5 ReturnMarket	17
2.1.6 Faktor Makro Ekonomi	18
2.1.6.1 Suku Bunga	19
2.1.6.2 Inflasi	19

2.1.6.3 Nilai Tukar	21
2.1.6.4 Harga Minyak Dunia	22
2.1.8 Penelitian Terdahulu	25
2.2 Hubungan Antar Variabel	28
2.2.1 Hubungan Suku Bunga Terhadap JII	28
2.2.2 Hubungan Inflasi Terhadap JII	29
2.2.3 Hubungan Nilai Tukar Terhadap JII	30
2.2.4 Hubungan Harga Minyak Dunia Terhadap JII	31
2.3 Kerangka Pemikiran	31
2.4 Hipotesis	33
BAB 3 METODE PENELITIAN.....	34
3.1 Jenis Penelitian	34
3.2 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	34
3.3 Sumber Data	38
3.4 Tahapan Peneliti	39
3.4.1 Uji Asumsi Klasik	39
3.4.1.1 Uji Normalitas	39
3.4.1.2 Uji Multikolinearitas	40
3.4.1.3 Uji Autokorelasi.....	41
3.4.1.4 Uji Heteroskedastisitas	42
3.4.2 Analisis Regresi Berganda	43
3.4.3 Pengujian Hipotesis	44
3.4.3.1 Uji Parsial (Uji-t)	44
3.4.3.2 Uji Simultan (Uji F).....	44
3.4.3.3 Koefisien Determinasi	45
BAB 4 HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	47
4.1 Hasil Penelitian	47
4.1.1 Deskriptif Variabel Penelitian	47
4.1.2 Hasil Deskriptif Variabel Penelitian	52
4.1.3 Hasil Uji Asumsi Klasik	57
4.1.3.1 Uji Normalitas	58

4.1.3.2 Uji Multikolinearitas	59
4.1.3.3 Uji Autokorelasi	60
4.1.3.4 Uji Heterokedastisitas	61
4.1.4 Hasil Analisis Regresi Berganda	62
4.1.5 Hasil Uji Hipotesis	65
4.1.5.1 Hasil Uji Parsial (Uji-t).....	65
4.1.5.2 Hasil Uji Simultan (Uji F)	67
4.1.5.3 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	68
4.2 Pembahasan	69
4.2.1 Pengaruh Suku Bunga Terhadap Return Indeks JII	69
4.2.2 Pengaruh Inflasi Terhadap Return Indeks JII	71
4.2.3 Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Return Indeks JII	72
4.2.4 Pengaruh Harga Minyak Dunia Terhadap Return Indeks JII	75
BAB 5 PENUTUP	78
5.1 Kesimpulan	78
5.2 Keterbatasan Penelitian	80
5.3 Rekomendasi	80
DAFTAR PUSTAKA	81
LAMPIRAN	84
BIODATA PENULIS	112