

DAFTAR TABEL

Halaman

Tabel 1.1 Perubahan Kenaikan Indeks IHSG Dan JII Periode 2009 – 2013 ..	5
Tabel 2.1 Daftar Perusahaan Yang Konsisten Masuk Dalam JII	15
Tabel 3.1 Definisi Operasional Variabel.....	37
Tabel 4.1 Return Indeks JII, BI Rate, Inflasi, Nilai Tukar, Harga Minyak Dunia Periode Januari 2009 – Desember 2013	47
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif	53
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Data	58
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas	59
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi	60
Tabel 4.6 Hasil Analisis Regresi Linear Berganda	63
Tabel 4.7 Hasil Uji Parsial (Uji-t).....	65
Tabel 4.8 Hasil Uji Simultan (Uji F)	67
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	69

DAFTAR GRAFIK

	Halaman
Grafik 1.1 Perkembangan JII Dan IHSG Di BEI Periode 2009 - 2013	5
Grafik 1.2 Pergerakan Indeks JII Periode 2009 - 2013	6
Grafik 4.1 Variabel Dependent Return Indeks JII Periode 2009 - 2013	50
Grafik 4.2 Variabel Independent BI Rate Periode 2009-2013	50
Grafik 4.3 Variabel Independent Inflasi Periode 2009-2013	51
Grafik 4.4 Variabel Independent Nilai Tukar Periode 2009-2013	51
Grafik 4.5 Variabel Independent Harga Minyak Dunia Periode 2009-2013 ..	52

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Teoritis	32
Gambar 4.8 Hasil Uji Heteroskedastisitas	62

Universitas Tanjungpura

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Suku Bunga (<i>BI rate</i>) di Bank Indonesia Periode 2009-2013.....	85
Lampiran 2 Inflasi (IHK) Di Bank Indonesia Periode 2009-2013.....	85
Lampiran 3 Nilai Tukar (Kurs Tengah) di Bank Indonesia 2009-2013.....	86
Lampiran 4 Harga Minyak Dunia (WTI) Periode 2009-2013	86
Lampiran 5 IndeksIHSG dan JII	87
Lampiran 6 Indeks JII Periode 2009-2013	87
Lampiran 7 Return Index <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	88
Lampiran 8 Daftar Saham JII Periode Desember 2008 - Mei 2009.....	89
Lampiran 9 Daftar Saham JII Periode Juni 2009 - November 2009.....	90
Lampiran 10 Daftar Saham JII Periode Desember 2009 - Mei 2010.....	91
Lampiran 11 Daftar Saham JII Periode Juni 2010 - November 2010	92
Lampiran 12 Daftar Saham JII Periode Desember 2010 - Mei 2011	93
Lampiran 13 Daftar Saham JII Periode Juni 2011 - November 2011	94
Lampiran 14 Daftar Saham JII Periode Desember 2011 - Mei 2012.....	95
Lampiran 15 Daftar Saham JII Periode Juni 2012 - November 2013	96
Lampiran 16 Daftar Saham JII Periode Desember 2012 - Mei 2013	97
Lampiran 17 Daftar Saham JII Periode Juni 2013 - November 2013	98
Lampiran 18 Daftar Saham JII Periode 2013 – Mei 2014	99
Lampiran 19 Daftar Perusahaan JII Sektor Pertanian	100
Lampiran 20 Daftar Perusahaan JII Sektor Pertambangan	100

Lampiran 21 Daftar Perusahaan JII Sektor Industri Dasar dan Kimia	101
Lampiran 22 Daftar Perusahaan JII Sektor Aneka Industri	101
Lampiran 23 Daftar Perusahaan JII Sektor Industri Barang Konsumsi	101
Lampiran 24 Daftar Perusahaan JII Sektor Properti dan Real Estate	102
Lampiran 25 Daftar Perusahaan JII Sektor Infrastruktur, Utilitas & Konsumsi	25
Lampiran 26 Daftar Perusahaan JII Sektor Perdagangan, Jasa & Investasi ..	103
Lampiran 27 Hasil Penelitian Menggunakan SPSS Versi 16	104

Universitas Tanjungpura

DAFTAR SINGKATAN

1. ASEAN : Association Of Southeast Asian Nation
2. Bapepam – LK : Badan Pengawas Pasar Modal dan
Lembaga Keuangan
3. BEI : Bursa Efek Indonesia
4. CAPM : Capital Asset Pricing Model
5. DES : Daftar Efek Syariah
6. DSN – MUI : Dewan Syariah Nasional Majelis Ulama Indonesia
7. DW : Durbin-Watson
8. ESS : Explained Sum Of Squares
9. GARCH-M : Generalised Autoregressive Conditional
Heteroskedasticity in Mean
10. IHK : Indeks Harga Konsumen
11. IHPB : Indeks Harga Perdagangan Besar
12. IHSG : Indeks Harga Saham Gabungan
13. ISO : International Organization For Standarization
14. ISSI : Indeks Saham Syariah Indonesia
15. JII : Jakarta Islamic Index
16. LQ – 45 : Liquid – 45
17. MINAS : Minyak Nasional
18. OJK : Otoritas Jasa Keuangan
19. OPEC : Organization Of Petroleum Exporting Countries

20. ORB : OPEC Reference Basket
21. PEFINDO : Pemeringkat Efek Indonesia
22. PHK : Pemutusan Hubungan Kerja
23. Rm : Return Market
24. RUPS : Rapat Umum Pemegang Saham
25. SBI : Sertifikat Bank Indonesia
26. SDRESID : Studentized Deleted Residual
27. SPSS : Statistical Product and Service Solution
28. SRI – KEHATI : Sustainable Responsible Investment-
Keanekaragaman Hayati Indonesia.
29. TSS : Total Sum Of Squares
30. ZPRED : Standardized Predicted Values