

DAFTAR ISI

SAMPUL DALAM.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN	iii
PERSETUJUAN PEMBIMBING	iv
PENGESAHAN	v
ABSTRAK.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I	
PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan Penelitian	9
D. Kegunaan Hasil Penelitian.....	10
BAB II	
KAJIAN PUSTAKA	
A. Kajian Teori	12
1. Pasar Modal.....	12
2. Jakarta Islamic Index	14
3. Return saham	16
3. Faktor Makro ekonomi	22
B. Penelitian yang Relevan.....	42
C. Paradigma Penelitian	48
D. Hipotesis Penelitian	49

BAB III	
METODE PENELITIAN	
A. Desain Penelitian	52
B. Definisi Operasional Variabel.....	53
C. Populasi dan Sampel Penelitian.....	57
D. Teknik Pengumpulan Data	58
E. Teknik Analisis Data	60
BAB IV	
HASIL PENELITIAN	
A. Deskripsi Umum	67
B. Analisis Data.....	69
BAB V	
PEMBAHASAN	
A. Uji Asumsi klasik.....	84
1. Uji Normalitas	84
2. Uji Heteroskedastitas.....	85
3. Uji Multikolinieritas	87
4. Uji Autokorelasi.....	88
B. Uji Hipotesis	89
1. Uji Parsial (Uji t)	89
2. Uji Simultan (Uji f).....	98
3. Persamaan Regresi Linier Berganda.....	99
BAB VI	
KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan	102
B. Saran.....	103
DAFTAR PUSTAKA	104
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Nomor	Keterangan	Halaman
2.0	Penelitian Terdahulu	46
4.0	Daftar Perusahaan JII yang Konstan Mulai Tahun 2011-2015	69
4.1	Deskriptif Statistik	69
4.2	Return Saham Jakarta Islamic Index 2011-2015	70
4.3	Data PDB Periode 2011-2015	72
4.5	Data Inflasi Periode 2011-2015	74
4.6	Data JUB Periode 2011-2015	75
4.7	Data Suku Bunga BI Periode 2011-2015	77
4.8	Data Nilai Tukar Rupiah Periode 2011-2015	79
4.9	Data Harga Minyak Dunia Periode 2011-2015	81
5.0	Data Indeks Dow Jones Periode 2011-2015	83
5.1	Pengujian Multikolinieritas	87
5.2	Pengujian Autokorelasi	88
5.3	Uji Parsial	89
5.4	Uji Simultan	98

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Keterangan	Halaman
2.0	Diagram Alur	48
4.0	Pergerakan Return JII (Januari 2011- Desember 2015)	70
4.1	Pergerakan PDB (Januari 2011- Desember 2015)	71
4.2	Pergerakan Inflasi (Januari 2011 – Desember 2015)	73
4.3	Pergerakan JUB (Januari 2011- Desember 2015)	74
4.4	Pergerakan SBI (Januari 2011- Desember 2015)	76
4.5	Pergerakan Nilai Tukar Rupiah terhadap US Dollar (Januari 2011- Desember 2015)	80
4.6	Pergerakan Harga Minyak Per Barrel (Januari 2011- Desember 2015)	81
4.7	Pergerakan DJIA (Januari 2011- Desember 2015)	82
5.0	Pengujian Normalitas Data	85
5.1	Pengujian Heteroskedastisitas	86