

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	
SURAT PERNYATAAN PENULIS	i
ABASTRAK	ii
المخلص.....	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN.....	v
PEDOMAN TRANSLITERASI	vi
KATA PENGANTAR DAN UCAPAN TERIMA KASIH	xi
DAFTAR ISI.....	xiv
DAFTAR TABEL DAN ILUSTRASI.....	xviii
DAFTAR LAMPIRAN	xx
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah.....	26
C. Tujuan Penelitian	27
D. Manfaat Hasil Penelitian	27
E. Kerangka Berpikir	28
F. Hipotesis	40
 BAB II TINJAUAN PUSTAKA	 43
A. Hasil Penelitian Terdahulu	43
B. Landasan Teori	55
1. Teori Ekonomi Makro	59
2. Teori Inflasi	62
3. Teori Suku Bunga.....	65
4. Teori Nilai Tukar	66
5. Teori Harga Minyak Dunia	67

6. Teori Pasar Modal Syariah	68
7. Teori <i>Return</i> Saham Syariah	74
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	82
A. Metode Penelitian.....	82
B. Jenis dan Sumber Data	83
C. Teknik Pengumpulan Data	85
D. Populasi dan Sampel.....	88
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian	88
F. Metode Analisis Data	90
1. Analisis Statistik Deskriptif	91
2. Uji Asumsi Klasik	92
a. Uji Normalitas.....	92
b. Uji Multikolinearitas	93
c. Uji Heteroskedastisitas.....	94
d. Uji Autokorelasi	95
3. Analisis Regresi Linier Berganda	96
4. Uji Hipotesis	98
a. Uji t (Parsial).....	99
b. Uji F (Simultan).....	99
c. Koefisien Determinasi (R^2)	100
5. Lokasi dan Waktu Penelitian	102
BAB IV PEMBAHASAN HASIL PENELITIAN.....	105
A. Deskripsi Data	105
1. Profil Lokasi Penelitian.....	105
2. Gambaran Data Penelitian.....	107
3. Karakteristik Penelitian	108
4. Pengukuran Return Saham Syariah.....	109
B. Hasil Penelitian.....	110
1. Hasil Uji Asumsi Klasik.....	110

a. Uji Normalitas	110
b. Uji Multikolinearitas	112
c. Uji Heteroskedastisitas	114
d. Uji Autokorelasi	116
2. Hasil Analisis Regresi Linier Berganda	118
3. Hasil Uji t (Parsial).....	120
4. Hasil Uji F (Simultan).....	121
5. Koefisien Determinasi (R^2)	122
C. Pembahasan Hasil Penelitian	123
1. Pengaruh Inflasi terhadap Return Saham Syariah.....	123
2. Pengaruh Suku Bunga terhadap Return Saham Syariah	126
3. Pengaruh Nilai Tukar terhadap Return Saham Syariah.....	128
4. Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Return Saham Syariah ..	130
5. Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar, dan Harga Minyak Dunia secara Simultan terhadap Return Saham Syariah.....	132
D. Penawaran Gagasan Baru	134
BAB V PENUTUP	138
A. Simpulan	138
B. Implikasi dan Keterbatasan Penelitian.....	140
C. Saran	142
DAFTAR PUSTAKA.....	145
LAMPIRAN.....	155
A. Lampiran A Data Return Saham Syariah (ISSI)	155
B. Lampiran B Data Inflasi.....	156
C. Lampiran C Data Suku Bunga	157
D. Lampiran D Data Nilai Tukar Rupiah terhadap USD	159
E. Lampiran E Data Harga Minyak Dunia	160
F. Lampiran F Output SPSS Hasil Uji Normalitas.....	163

G. Lampiran Output G SPSS Hasil Uji Multikolinieritas.....	163
H. Lampiran Output H SPSS Hasil Uji Autokorelasi	164
I. Lampiran Output I SPSS Hasil Uji Heteroskedastisitas	165
J. Lampiran Output J SPSS Hasil Estimasi Regresi Linier Berganda	166
RIWAYAT HIDUP.....	167

