

DAFTAR ISI

	Hal
LEMBAR PERNYATAAN	ii
REKOMENDASI PEMBIMBING	iii
NOTA DINAS	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO	vi
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
KATA PENGANTAR	ix
TRANSLITERASI	xii
DAFTAR ISI	xxi
DAFTAR TABEL	xxiv
DAFTAR DIAGRAM	xxvi
DAFTAR GAMBAR	xxvii
DAFTAR LAMPIRAN	xxviii
BAB I: PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan dan Manfaat Penelitian	7
1. Tujuan Penelitian	7
2. Manfaat Penelitian	8
D. Telaah Pustaka	8
E. Perumusan Hipotesis	17
F. Sistematika Pembahasan	19
BAB II: LANDASAN TEORI	20
A. Pasar Modal dan Bursa Efek Indonesia	20
B. Pasar Modal Syariah	25
C. <i>Jakarta Islamic Index</i>	32

D. Harga Saham.....	34
E. Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	35
BAB III: METODE PENELITIAN.....	37
A. Sifat dan Jenis Penelitian.....	37
B. Populasi dan Penentuan Sampel	37
C. Sumber Data	39
1. Jenis Data	39
2. Teknik Pengumpulan Data.....	39
3. Definisi Operasional Variabel.....	40
a. Variabel Dependen (Y).....	40
b. Variabel Independen (X)	40
4. Teknik Analisis Data.....	45
a. Regresi Linier Berganda	45
b. Uji Asumsi Klasik	46
1) Uji Normalitas.....	46
2) Uji Multikolinieritas	46
3) Uji Heterokedastisitas	47
4) Uji Autokorelasi.....	47
5) Koefisien Determinasi (R Square).....	47
c. Uji Hipotesis	48
1) Uji Parsial (Uji t).....	48
2) Uji Simultan (Uji F).....	48
d. Desain Penelitian	50
BAB IV: HASIL PENELITIAN, ANALISIS DAN PEMBAHASAN	51
A. Deskripsi Obyek Penelitian	51
1. Deskripsi Statistik JII.....	51
2. Profil PT AKR Corporindo Tbk.....	52
3. Profil PT United Tractors Tbk	55
4. Profil PT Semen Indonesia (persero) Tbk.....	59
5. Profil PT Indocement Tunggak Prakarsa Tbk	62

6. Profil PT Perusahaan Gas Negara (persero) Tbk	65
7. Profil PT Telekomunikasi Indonesia (persero) Tbk	69
8. Profil PT Lippo Karawaci Tbk.....	72
9. Profil PT Alam Sutera Ralty Tbk	76
10. Profil PT Indofood CBP Sukses makmur Tbk.....	79
11. Profil PT Unilever Indonesia Tbk.....	82
12. Deskripsi Statistik Inflasi	85
13. Deskripsi Statistik PDB	87
B. Uji Asumsi Klasik.....	88
1. Uji Normalitas.....	88
2. Uji Multikolinieritas.....	89
3. Uji Heteroskedastisitas.....	89
4. Uji Autokorelasi.....	90
C. Analisis Statistik	92
1. Interpretasi Persamaan Regresi.....	92
2. Pengujian Hipotesis.....	93
a. Hasil Uji Regresi Parsial (Uji t).....	93
b. Hasil Uji Regresi Simultan (Uji F).....	97
3. Koefisien Determinasi (R Square).....	98
D. Analisis dan Pembahasan	99
E. Keterbatasan Penelitian.....	102
BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN.....	105
A. Kesimpulan.....	105
B. Saran	105
DAFTAR PUSTAKA.....	107
LAMPIRAN.....	112

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.2 Proses Seleksi Saham Syariah oleh Dewan Syariah Nasional Majelis Ulama Indonesia (DSN-MUI).....	29
Gambar 4.1 Grafik Pergerakan Saham JII Indonesia Periode Juni 2012 – Mei 2015	49
Gambar 4.2 Grafik Perkembangan Laju Inflasi Indonesia Periode Juni 2012 – Mei 2015	83
Gambar 4.3 Grafik Perkembangan Produk Domestik Bruto Indonesia Periode kuartal III pada 2012 – Kuartal II pada 2015	84



DAFTAR DIAGRAM

Diagram 2.1 Struktur Pasar Keuangan.....	20
Diagram 3.1 Desain Penelitian	48



DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Penelitian Terdahulu	13
Tabel 2.1 Aspek Hukum Dalam Investasi	28
Tabel 4.1 Sejarah Pencatatan Saham AKRA	51
Tabel 4.2 Kinerja Fundamental Perusahaan AKR Corporindo Tbk	51
Tabel 4.3 Sejarah Pencatatan Saham UNTR	54
Tabel 4.4 Kinerja Fundamental Perusahaan United Tractors Tbk.....	55
Tabel 4.5 Sejarah Pencatatan Saham SMGR	57
Tabel 4.6 kinerja Fundamental Perusahaan Semen Indonesia.....	58
Tabel 4.7 Sejarah Pencatatan Saham INTP	60
Tabel 4.8 Kinerja Fundamental Indocement Tunggal Prakarsa.....	61
Tabel 4.9 Sejarah Pencatatan Saham PGAS	64
Tabel 4.10 Kinerja Fundamental Perusahaan Gas Negara.....	65
Tabel 4.11 Sejarah Pencatatan Saham TLKM.....	68
Tabel 4.12 Kinerja Fundamental Perusahaan Telekomunikasi.....	68
Tabel 4.13 Sejarah Pencatatan Saham LPKR	71
Tabel 4.14 Kinerja Fundamental Perusahaan Lippo Karawaci Tbk	72
Tabel 4.15 Sejarah Pencatatan Saham ASRI	75
Tabel 4.16 Kinerja Fundamental Perusahaan Alam Sutera	75
Tabel 4.17 Sejarah Pencatatan Saham ICBP	78
Tabel 4.18 Kinerja Fundamental Perusahaan Indofood.....	78
Tabel 4.19 Sejarah Pencatatan Saham UNVR	81
Tabel 4.20 Kinerja Fundamental Perusahaan Unilever	81
Tabel 4.21 Hasil Uji Normalitas	86
Tabel 4.22 Hasil Uji Multikolinieritas	87
Tabel 4.23 Hasil Uji Heteroskedastisitas	88
Tabel 4.24 Hasil Uji Autokorelasi	89
Tabel 4.25 Analisis Regresi Linier Berganda	90
Tabel 4.26 Hasil Uji Parsial (Uji t)	92

Tabel 4.27 Hasil Uji Simultan (Uji F)	95
Tabel 4.28 Kontribusi Variabel Independen terhadap Variabel	96
Tabel 4.29 Nilai Koefisien Determinasi (R Square).....	97
Tabel 4.30 Aspek Hukum Dalam Investasi	98



DAFTAR LAMPIRAN

Daftar Perusahaan JII Juni 2012 – November 2012	112
Daftar Perusahaan JII Desember 2012 – Mei 2013	113
Daftar Perusahaan JII Juni 2013 – November 2013	114
Daftar Perusahaan JII Desember 2013 – Mei 2014	115
Daftar Perusahaan JII Juni 2014 – November 2014	116
Daftar Perusahaan JII Desember 2014 – Mei 2015	117
Data Harga Saham	118

