

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN PENULIS.....	i
ABSTRAK.....	ii
ABSTRACT.....	iii
LEMBAR PERSETUJUAN.....	iv
LEMBAR PENGESAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	9
1.3 Batasan Masalah.....	9
1.4 Tujuan Penelitian.....	10
1.5 Kegunaan Penelitian.....	10
1.6 Kerangka Pemikiran.....	11
1.7 Kerangka Berpikir.....	12
1.8 Hipotesis Penelitian.....	13

BAB II ANALISIS TEORI

2.1 Pasar Modal Syariah dan Konvensional.....	15
2.2 Jenis-jenis Saham.....	16
2.2.1 Saham Biasa.....	16
2.2.2 Saham <i>Preferen</i>	17
2.3 Resiko Investasi Dalam Sekuritas.....	19
2.4 Deviden	20
2.4.1 Deviden Saham.....	21

2.4.2	Deviden Tunai.....	21
2.4.3	Kontroversi Pembayaran Deviden.....	22
2.5	<i>Capital Gain</i>	23
2.6	Saham Berbasis Syariah.....	24
2.7	Transaksi Efek Yang Dilarang.....	26
2.8	<i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	27
2.9	<i>Arbitrage Pricing Theory (APT)</i>	28
2.10	<i>Return Saham</i>	28
2.11	Kurs Rupiah.....	30
2.12	<i>Debt To Equity Ratio (DER)</i>	31
2.13	Penelitian Sebelumnya.....	33

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Jenis dan Sumber Data.....	40
3.2	Populasi.....	40
3.3	Metode Pengumpulan Data.....	43
3.4	Definisi Operasional Variabel.....	44
3.5	Teknik Analisis Data.....	45
3.5.1	Regresi Linier Berganda.....	45
3.5.2	Pengujian Asumsi Klasik.....	46
3.5.2.1	Uji Normalitas.....	47
3.5.2.2	Uji Multikolinearitas.....	47
3.5.2.3	Uji Autokorelasi.....	48
3.5.2.4	Uji Heterokedastisitas.....	49
3.5.3	Uji Kelayakan Model.....	49
3.5.3.1	Uji F.....	50
3.5.3.2	Analisis Koefisien Determinasi (R^2).....	50
3.5.4	Pengujian Hipotesis (Uji t)	51

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Hasil Penelitian.....	53
4.1.1	Gambaran Umum Objek Penelitian.....	53

4.1.2	Pengumpulan Data.....	55
4.1.3	Analisis Statistik Penelitian.....	60
4.1.4	Pengujian Asumsi Klasik.....	61
4.1.4.1	Uji Normalitas.....	61
4.1.4.2	Uji Multikolinearitas.....	63
4.1.4.3	Uji Autokorelasi.....	63
4.1.4.4	Uji Heterokedastisitas.....	64
4.1.5	Uji Kelayakan Model.....	67
4.1.5.1	Uji F.....	67
4.1.5.2	Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	68
4.1.5.3	Hasil Analisis Regresi Linier Berganda.....	69
4.1.5.4	Pengujian Hipotesis (Uji t).....	70
4.2	Pembahasan.....	71
4.2.1	Pengaruh Kurs Rupiah Terhadap <i>Return</i> Saham.....	71
4.2.2	Pengaruh DER Terhadap <i>Return</i> Saham.....	73
4.2.3	Pengaruh Kurs Rupiah dan DER Thd <i>Return</i> Saham.....	74
4.2.4	Masalah Yang Dihadapi.....	75
4.2.5	Implikasi Hasil Penelitian	75
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Kesimpulan.....	77
5.2	Saran.....	78
DAFTAR PUSTAKA.....		80
LAMPIRAN.....		82

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Kapitalisasi Pasar Saham Syariah BEI (Rp. Miliar).....	3
Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Sebelumnya.....	37
Tabel 3.1 Populasi Penelitian.....	41
Tabel 3.2 Sampel Perusahaan Yang Diteliti.....	43
Tabel 3.3 Definisi Operasional Variabel.....	44
Tabel 4.1 Data Harga Saham Dan <i>Return</i> Saham.....	55
Tabel 4.2 <i>Summary Return</i> Saham.....	58
Tabel 4.3 Data Kurs Rupiah.....	59
Tabel 4.4 Data <i>Debt To Equity Ratio</i> (DER).....	59
Tabel 4.5 Hasil Analisis Karakteristik Data Sampel.....	60
Tabel 4.7 Hasil Uji Multikolinearitas.....	63
Tabel 4.8 Hasil Uji Durbin-Watson.....	64
Tabel 4.9 Hasil Uji Glejser.....	66
Tabel 4.10 Hasil Perhitungan Uji F.....	67
Tabel 4.11 Hasil Perhitungan Koefisien Determinasi (R^2).....	68
Tabel 4.12 Hasil Perhitungan Regresi Linier Berganda.....	69
Tabel 4.13 Hasil Perhitungan Hipotesis (Uji t).....	70

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik Perkembangan Saham Syariah.....	5
Gambar 1.2 Grafik Kurs Rupiah.....	7
Gambar 1.3 Kerangka Berpikir Penelitian.....	13
Gambar 4.1 Normal <i>Probability</i> Plot Data.....	62
Gambar 4.2 Grafik Scatterplot.....	65

