

DAFTAR ISI

TITLE PAGE	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN ORSINALITAS SKRIPSI.....	iv
DECLARATION	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK.....	viii
ABSTRACT.....	ix
المستخلص	x
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	xi
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR GAMBAR	xviii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xix
DAFTAR SINGKATAN	xx
DAFTAR PERSAMAAN.....	1
BAB 1 PENDAHULUAN	2
1.1 Latar Belakang	2
1.2 Kesenjangan Penelitian	10
1.3 Tujuan Penelitian	11
1.4 Manfaat Penelitian	12
1.5 Ringkasan Hasil Penelitian	12
1.6 Sistematika Penulisan	12
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1 Landasan Teori.....	14
2.1.1 Pasar Modal	14
2.1.2 Pasar Modal Syariah.....	15
2.1.3 Jakarta Islamic Index.....	18
2.1.4 Faktor Makroekonomi.....	19
2.1.5 Faktor Fundamental.....	21
2.1.6 Return Saham	24
2.2 Penelitian Sebelumnya.....	25

2.3	Hipotesis	29
2.3.1	Pengaruh Inflasi Terhadap Return Saham.....	29
2.3.2	Pengaruh Gross Domestic Product Terhadap Return Saham.....	29
2.3.3	Pengaruh <i>Earning per Share</i> terhadap return saham.....	30
2.3.4	Pengaruh <i>debt to Equity Ratio</i> Terhadap Return Saham.....	31
2.3.5	Pengaruh <i>Return on Equity</i> Terhadap Return Saham.....	31
BAB 3 METODE PENELITIAN		33
3.1	Pendekatan Penelitian	33
3.2	Model Empiris	33
3.3	Definisi Operasional Variabel.....	34
3.3.1	Variabel Independen.....	34
3.3.2	Variabel Dependen	36
3.4	Jenis dan Sumber Data.....	36
3.5	Prosedur pengumpulan data.....	37
3.5.1	Kriteria Populasi dan Sampel	37
3.5.2	Pengumpulan Data	38
3.6	Teknik analisis	38
3.6.1	Statistik Deskriptif.....	39
3.6.2	Uji Asumsi Klasik	39
3.6.3	Analisis Regresi Linear Berganda.....	41
3.6.4	Pengujian Hipotesis.....	42
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN		44
4.1	Gambaran Umum.....	44
4.2	Deskriptif statistik Variabel	45
4.3	Hasil Estimasi dan Pembuktian Hipotesis	46
4.3.1	Uji Asumsi Klasik	46
4.3.2	Uji Regresi Linear Berganda.....	50
4.3.3	Uji Hipotesis.....	52
4.4	Interpretasi Hasil.....	55
4.4.1	Pengaruh Inflasi terhadap return saham JII.....	55
4.4.2	Pengaruh GDP terhadap return saham JII	55
4.4.3	Pengaruh <i>Earning Per Share</i> terhadap return saham JII.....	56
4.4.4	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap return saham JII	57
4.4.5	Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap return saham JII.....	58
4.4.6	Pengaruh Variabel Independen Terhadap Return Saham JII	59
BAB 5		60

5.1	RINGKASAN HASIL	60
5.2	KESIMPULAN.....	60
5.3	SARAN	61
5.4	KETERBATASAN.....	62
	DAFTAR PUSTAKA	63
	LAMPIRAN.....	67

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Sebelumnya	33
Tabel 3.1 Daftar perusahaan JII tahun 2014-2018.....	36
Tabel 3.2 Ketentuan Autokorelasi	39
Tabel 4.1 Daftar perusahaan di JII tahun 2014-2018.....	42
Tabel 4.2 Hasil perhitungan Statistik Deskriptif.....	43
Tabel 4.3 Hasil Pengujian Normalitas	45
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas	46
Tabel 4.5 Hasil Uji Glejser.....	47
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi.....	48
Tabel 4.7 Hasil Uji Regresi Linear Berganda.....	49
Tabel 4.8 Hasil Uji t	50
Tabel 4.9 Hasil Uji F	52
Tabel 4.10 Hasil Uji Determinasi	52

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Rata-rata return pada JII tahun 2014-2018	3
Gambar 1.2	Perbandingan Inflasi terhadap return	4
Gambar 1.3	Perbandingan GDP terhadap return	5
Gambar 3.1	Model Empiris	32
Gambar 3.2	Daftar perusahaan JII tahun 2014-2018.....	36
Gambar 4.1	Grafik probability plot	45
Gambar 4.2	Uji scatterplot.....	47

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Tabulasi data variabel inflasi, GDP, EPS,DER ROE.....	66
Lampiran 2. Data harga saham di JII	68
Lampiran 3. Data hasil return saham.....	68
Lampiran 4. Hasil deskriptif statistik	69
Lampiran 5. Hasil uji normalitas	69
Lampiran 6. Hasil uji multikolinearitas	70
Lampiran 7. Hasil uji glejser.....	70
Lampiran 8. Hasil uji autokorelasi	70
Lampiran 9. Hasil uji regresi linear berganda.....	71
Lampiran 10. Hasil uji F.....	71
Lampiran 11. Hasil uji determinasi	71
Lampiran 12. Hasil uji turnitin	72

.

DAFTAR SINGKATAN

GDP	= <i>Gross domestic product</i>
EPS	= <i>Earning per share</i>
DER	= <i>Debt to equity ratio</i>
ROE	= <i>Return on equity</i>
JII	= <i>Jakarta Islamic Index</i>

DAFTAR PERSAMAAN

2.1	Rumus Inflasi	20
2.2	Rumus EPS	22
2.3	Rumus DER.....	23
2.4	Rumus ROE.....	24
3.1	Persamaan Multiple Regression.....	33
3.2	Rumus Inflasi.....	35
3.3	Rumus EPS.....	36
3.4	Rumus DER.....	36
3.5	Rumus ROE.....	36
3.6	Regresi Linear Berganda.....	41