

**KEMENTERIAN PENDIDIKAN DAN KEBUDAYAAN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

PROGRAM STUDI : EKONOMI ISLAM
DAFTAR No. :

ABSTRAK
SKRIPSI SARJANA EKONOMI

NAMA : AJENG RISKI SAFITRI
NIM : 041014018
TAHUN PENYUSUNAN : 2013-2014

JUDUL :
Pengaruh Tingkat Inflasi, Tingkat Suku Bunga Dalam Negeri Dan *Ekuivalent Rate Of Return* Terhadap Indeks Harga Saham Syariah Indonesia (Studi Pada JII Periode 2009.1 – 2012.12)

ISI :

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui ada tidaknya pengaruh variabel makroekonomi secara parsial dan simultan terhadap indeks harga saham syariah atau indeks JII. Populasi dari penelitian ini adalah data yang diperoleh dari laporan bulanan Bank Indonesia, dan statistik Bursa Efek Indonesia (JII) periode 2009.1 – 2012.12, data yang digunakan adalah data bulanan.

Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif yaitu data diukur dalam skala numerik dengan menggunakan metode sampel jenuh. Variabel dalam penelitian ini terdiri dari inflasi (X_1), suku bunga atau *BI Rate* (X_2) dan *equivalent rate of return* (X_3). Data dianalisis dengan teknik regresi linier berganda yang kemudian hasilnya akan diinterpretasikan.

Hasil penelitian ini menunjukkan secara parsial inflasi (X_1) berpengaruh positif signifikan terhadap indeks JII (Y), dengan nilai koefisien sebesar 28,426. suku bunga (X_2) berpengaruh negatif signifikan terhadap indeks JII (Y), dengan nilai koefisien sebesar $-182,576$. *Equivalent rate of return* (X_3) berpengaruh positif signifikan terhadap indeks JII (Y), dengan nilai koefisien sebesar 14,126. Secara simultan, seluruh variabel eksogen berpengaruh terhadap indeks JII, berdasarkan hasil uji F hitung sebesar 87,513 dengan nilai signifikansi sebesar 0,000. Nilai R^2 adalah 0,856, dengan demikian variabel inflasi (X_1), suku bunga atau *BI Rate* (X_2) dan *equivalent rate of return* (X_3) menjelaskan 85,6% variasi pada Indeks JII.

Kata kunci: Makro ekonomi, Inflasi, Suku bunga, Equivalent Rate of Return, Indeks JII.