

**PENGARUH RESIKO SISTEMATIS DAN KINERJA  
PERUSAHAAN TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN  
YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX  
PERIODE 2014-2018**

**SKRIPSI**

**DIAJUKAN UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN PERSYARATAN  
DALAM MEMEPEROLEH GELAR  
SARJANA EKONOMI**



**DIAJUKAN OLEH:  
NURUL LAILI RAHMAWATI  
NIM. 041411431068**

**PROGRAM STUDI S1 EKONOMI ISLAM**

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS AIRLANGGA  
SURABAYA  
2020**

**SKRIPSI**

**PENGARUH RESIKO SISTEMATIS DAN KINERJA PERUSAHAAN  
TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR  
DI JAKARTA ISLAMIC INDEX PERIODE 2014-2018**

**DIAJUKAN OLEH:  
NURUL LAILI RAHMAWATI  
NIM: 041411431068**

**TELAH DISETUJUI DAN DITERIMA DENGAN BAIK OLEH**

**DOSEN PEMBIMBING,**



**PUJI SUCIA SUKMANINGRUM, SE., CFP  
NIP. 198412212014042001**

**TANGGAL** 27 Januari 2020

**KOORDINATOR PROGRAM STUDI,**



**NOVEN SUPRAYOGI, S.E., M.Si., Ak.  
NIP. 197711052008121001**

**TANGGAL** 27 Januari 2020

**PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI**

Saya, (Nurul Laili Rahmawati, 041411431068), menyatakan bahwa:

1. Skripsi saya ini adalah asli dan benar-benar hasil karya saya sendiri, dan bukan hasil karya orang lain dengan mengatas namakan saya, serta bukan merupakan hasil peniruan atau penjiplakan (*plagiarism*) dari karya orang lain. Skripsi ini belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik baik di Universitas Airlangga, maupun diperguruan tinggi lainnya.
2. Dalam Skripsi ini tidak terdapat karya atau pendapat yang telah ditulis atau dipublikasikan orang lain, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan dalam daftar kepustakaan.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya, dan apabila dikemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran dalam pernyataan ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh karna karya tulis Skripsi ini, serta sanksi-sanksi lainnya sesuai dengan norma dan peraturan yang berlaku di Universitas Airlangga.

Surabaya, 27 Januari 2020



Nurul Laili Rahmawati

NIM: 041411431068

DECLARATION

I, (Nurul Laili Rahmawati, 04114131068) declare that:

1. My thesis is genuine and truly my own creation, and is not another's person work made under my name, nor a piracy or plagiarism. This thesis has never been submitted to obtain an academic degree in Universitas Airlangga or in any other Universities/Colleges.
2. This thesis does not contain any work or opinion written or published by anyone, unless clearly acknowledged or referred to by quoting the author's name and stated in the references.
3. This statement is true; if on the future this statement is proven to be fraud and dishonest, I agree to receive an academic sanction in the form of removal of the degree obtained through this thesis, and other sanctions in accordance with the prevailing norms and regulations in Universitas Airlangga.

Surabaya, ..... 27 Januari 2020

Declared by,



Nurul Laili Rahmawati

NIM. 041411431068

## KATA PENGATAR

Assalamu' alaikum Wr. Wb

Segala puji kehadiran Allah SWT yang telah memberikan saya waktu, kesehatan, kemudahan, ketabahan, untuk menyelesaikan skripsi ini. Shalawat serta salam selalu tercurahkan kepada Nabi Muhammad SAW.

Skripsi ini berjudul **PENGARUH RESIKO SISTEMATIS DAN KINERJA PERUSAHAAN TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX PERIODE 2014-2018**. Merupakan salah satu persyaratan akademik untuk mendapatkan gelar Sarjana Ekonomi Islam, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.

Pada kesempatan ini dengan segala kerendahan hati, penulis sampaikan terima kasih yang tidak terhingga kepada:

1. Prof. Dr. Hj. Dian Agustia, SE., M.Si., Ak. selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.
2. Dr. Raditya Sukmana, SE., M.A. selaku Ketua Departemen Ekonomi Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.
3. Noven Suprayogi, SE., M.Si., Ak. selaku Kordinator Program Studi Ekonomi Islam Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.
4. Puji Sucia Sukmaningrum, SE., CIFP. selaku Dosen Pembimbing Skripsi. Terimakasih telah meluangkan waktu dan dengan sabar membimbing peneliti selama proses penelitian skripsi.
5. Dr. Achsanah Hendratmi, SE., M.Si. selaku dosen wali yang selalu membantu dan memberikan saran serta masukan kepada peneliti dalam menyelesaikan kegiatan akademik selama berada di Universitas Airlangga.
6. Seluruh dosen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga, khususnya dosen Departemen Ekonomi Islam yang tidak dapat disebutkan satu-persatu oleh penulis, terimakasih telah memberikan ilmu kepada penulis selama perkuliahan.
7. Staff Administrasi Departemen Ekonomi Syariah Pak Syaiful dan ibu Nuning, staff Bagian Akademik dan Kemahasiswaan Mas Lukman dan Pak Wiji, dan

staff Ruang Baca Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga atas segala bantuannya yang telah dilakukannya.

8. Bapak Mufasir dan Ibu Mutmainah selaku Orang Tua terima kasih atas semua kasih sayang, motivasi semangat dan tiada hentinya mendoakan penulis. Terimakasih telah menjadi sumber semangat utama penulis dalam menyelesaikan skripsi.
9. Khurrotul Aini selaku Adek penulis yang telah memberikan semangat dan membantu dalam menjejarkan skripsi.
10. Jajak Yudo Prasetyo terimakasih selalu memberikan semangat, membantu, dan menemani dalam menyelesaikan skripsi.
11. Sahabat SMP dan SMA Amelinda Devina, Rosyidah Imsiyah, dan Putri Retno yang sudah mendoakan dan memberikan semangat.
12. Liyak, Sitha, Danty terimakasih sudah menemani dan selalu menghibur dikalah susah senang selama perkuliahan.
13. Alifudin, Pink, Dian, Halim terimakasih sudah membantu dan seluruh teman-teman penulis Ekonomi Islam 2014.

Penulis telah berusaha semaksimal mungkin, namun penulis menyadari masih banyak kekurangan dalam penyusunan skripsi ini, untuk itu penulis mengharapkan kritik dan saran yang bersifat membangun dari pembaca.

Wassalamu'alaikum Wr.Wb.

Surabaya, 2020

Nurul Laili Rahmawati  
041411431068