DAFTAR ISI

SAMPUL DALAM i
PERNYATAAN KEASLIAN ii
PERSETUJUAN PEMBIMBING iii
PENGESAHAN iv
ABSTRAK v
KATA PENGANTAR vi
DAFTAR ISI viii
DAFTAR TABEL xiii
DAFTAR GAMBAR xiv
DAFTAR TRANSLITERASI xv

BAB I PENDAHULUAN
A. Latar Belakang 1
B. Rumusan Masalah 9
C. Tujuan Penelitian 9
D. Kegunaan Hasil Penelitian 10

BAB II KAJIAN PUSTAKA
A. Landasan Teori 12
1. Indeks Harga Saham Gabungan 12
2. Jakarta Islamic Indeks 12
3. Teori Variabel Makroekonomi 13
a. Produk Domestik Bruto 13
b. Tingkat Inflasi 15
c. Tingkat Jumlah Uang Beredar 18
d. Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar AS 19
e. Tingkat Suku Bunga SBI 21

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

f. Harga Minyak Dunia 22
g. Indeks Dow Jones 23
4. Pengaruh Variabel Makroekonomi terhadap Indeks Harga Saham.....24
a. Pengaruh Produk Domestik Bruto (PDB) terhadap IHSG dan JII 24
b. Pengaruh Tingkat Inflasi terhadap IHSG dan JII.....25
c. Pengaruh Tingkat Jumlah Uang Beredar terhadap IHSG dan JII 26
d. Pengaruh Nilai Tukar terhadap IHSG dan JII 26
e. Pengaruh Tingkat Suku Bunga terhadap IHSG dan JII....27
f. Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap IHSG dan JII.....28
g. Pengaruh Indeks Dow Jones terhadap IHSG dan JII 29
B. Penelitian Terdahulu yang Relevan.....30
C. Kerangka Konseptual.....39
D. Hipotesis.....41

BAB III METODE PENELITIAN
A. Pendekatan Penelitian 43
B. Waktu dan Tempat Penelitian 44
C. Populasi dan Sampel Penelitian 44
D. Variabel Penelitian 45
E. Definisi Operasional 47
1. Independen Variabel.....47
a. Indeks Harga Saham Gabungan.....47
b. Jakarta Islamic Indeks.....47
2. Dependen Variabel 48
a. Produk Domestik Bruto 48
b. Inflasi.....48
c. Jumlah Uang Beredar.....49

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

d. Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar AS 49
e. Suku Bunga Indonesia ..... 50\
f. Tingkat Pertumbuhan Harga Minyak 50
g. Indeks Dow Jones 51
F. Data dan Sumber Data 51
G. Teknik Pengumpulan Data dan Analisis Data 53
1. Teknik Pengumpulan Data 53
a. Field Research 53
b. Internet Research 53
2. Teknik Analisis Data 54
a. Regresi Berganda 54
b. Uji Asumsi Klasik 55
1) Uji Heteroskedastisitas 55
2) Uji Autokolerasi 56
3) Uji Normalitas 56
4) Uji Multikolinearitas 57
c. Uji Hipotesis 58
1) Uji t 58
2) Uji f 59

BAB IV HASIL PENELITIAN
A. Sejarah Singkat Berdirinya Indeks Harga Saham Gabungan 61
1. Profil Indeks Harga Saham Gabungan 61
2. Komponen Indeks Harga Saham Gabungan 62
3. Proses Pelaksanaan Perdagangan 67
a. Proses Pelaksanaan Perdagangan di Bursa 67
b. Proses Pelaksanaan Perdagangan secara Remote 68
B. Sejarah Singkat Berdirinya Jakarta Islamic Indeks 70
1. Profil Jakarta Islamic Indeks 70
2. Kriteria Emiten di Jakarta Islamic Indeks 70

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

3. Komponen Saham Jakarta Islamic Indeks 73
4. Proses Pelaksanaan Perdagangan 75
a. Proses Pelaksanaan Perdagangan di Bursa 75
b. Proses Pelaksanaan Perdagangan Secara Remote 76
C. Deskripsi Variabel Penelitian 78
1. Perkembangan Data Indeks Harga Saham Gabungan 78
2. Perkembangan Data Jakarta Islamic Indeks 80
3. PDB 82
4. Inflasi 84
5. Jumlah Uang Beredar 86
6. Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar AS 88
7. Suku Bunga Bank Indonesia (SBI) 90
8. Tingkat Pertumbuhan Harga Minyak 92
9. Indeks Dow Jones 94
D. Analisis dan Pembahasan 96
1. Uji Normalitas 96
2. Uji Multiolenieritas 98
3. Uji Heteroskedastisitas 99
4. Uji Autokolerasi 101
5. Regresi Linear Berganda 102
6. Uji Hipotesis 106
a. Uji Simultan (Uji f) ..... 106\
b. Uji Parsial (Uji t) 109

BAB V PEMBAHASAN

A. Pembahasan Hasil Penelitian 113
1. Pengaruh Simultan 113
a. Pengaruh Simultan Variabel Makroekonomi terhadap IHSG 113

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

b. Pengaruh Simultan Variabel Makroekonomi terhadap JII 114
2. Pengaruh Parsial 116
a. Pengaruh Parsial Variabel Makroekonomi terhadap IHSG 116
1) PDB 116
2) Inflasi 117
3) Jumlah Uang Beredar 118
4) Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar AS 119
5) Tingkat Suku Bunga 120
6) Harga Minyak 121
7) Indeks Dow Jones 122
b. Pengaruh Parsial Variabel Makroekonomi terhadap JII 123
1) Pertumbuhan GDP 123
2) Inflasi 124
3) Jumlah Uang Beredar 125
4) Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar AS 126
5) Tingkat Suku Bunga 128
6) Harga Minyak Dunia 129
7) Indeks Dow Jones 130

BAB VI PENUTUP
A. KESIMPULAN 132
B. SARAN 140

DAFTAR PUSTAKA 141

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id