

## DAFTAR ISI

Halaman Sampul Depan .....	i
Halaman Judul .....	ii
Halaman Persetujuan .....	iii
Halaman Pengesahan .....	iv
Halaman Motto .....	v
Halaman Persembahan .....	vi
Kata Pengantar .....	vii
Daftar Isi .....	x
Daftar Tabel .....	xv
Daftar Gambar .....	xvi
Daftar Lampiran .....	xvii
Transliterasi .....	xviii
Abstrak .....	xxi

## BAB I : PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Identifikasi Masalah .....	12
C. Rumusan Masalah .....	13
D. Tujuan Penelitian .....	13
E. Kegunaan Penelitian .....	14
F. Ruang Lingkup Dan Batasan Penelitian .....	15

G. Penegasan Istilah .....	16
H. Sistematika Pembahasan Skripsi .....	21

## **BAB II : LANDASAN TEORI**

A. Kerangka Teori .....	24
1. Pasar Modal Syariah .....	24
2. Nilai Tukar Rupiah .....	30
3. Tingkat Suku Bunga <i>BI Rate</i> .....	32
4. <i>Return</i> Saham Syariah .....	35
5. Perusahaan Industri Sektor Barang Konsumsi .....	45
B. Teori Utama.....	47
C. Kajian Penelitian Terdahulu .....	50
D. Kerangka Berpikir Peneliti .....	60
E. Hipotesis Peneliti.....	62

## **BAB III : METODE PENELITIAN**

A. Pendekatan dan Jenis Penelitian .....	64
1. Pendekatan Penelitian .....	64
2. Jenis Penelitian .....	65
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian .....	66
C. Sumber data, Variabel dan Skala Pengukuran .....	67
1. Sumber Data .....	67
2. Variabel Penelitian.....	68

3. Skala Pengukuran .....	69
D. Teknik Pengumpulan Data dan Instrumen Penelitian .....	70
1. Teknik Pengumpulan Data .....	70
2. Instrumen Penelitian .....	72
E. Kisi – Kisi Instrumen Penelitian .....	72
F. Analisis Data .....	73
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	73
2. Uji Normalitas .....	74
3. Uji Asumsi Klasik .....	74
4. Analisis Regresi Linier Berganda .....	76
5. Pengujian Hepotesis .....	77
6. Uji Koefisien Determinan ( $R^2$ ) .....	79

#### **BAB IV : HASIL PENELITIAN**

A. Deskripsi Data .....	80
1. Data Return Saham Syariah Bulanan Dari Perusahaan Industri Sektor Barang Konsumsi Dalam Daftar Efek Syariah (DES) Tahun 2013-2016 .....	81
2. Analisis Deskriptif Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Suku Bunga BI <i>Rate</i> dan <i>Return</i> Saham Syariah .....	85
B. Pengujian Hipotesis .....	87
1. Uji Standarisasi ( <i>Z- Score</i> ) .....	87
2. Uji Normalitas .....	87

3. Uji Asumsi Klasik .....	91
a. Uji Multikolonieritas.....	91
b. Uji Autokorelasi .....	92
c. Uji Heteroskedasitas .....	93
4. Uji Regresi Linier Berganda .....	94
5. Hasil Uji Hipotesis.....	97
a. Uji Signifikansi Secara Parsial dengan t-test .....	97
b. Uji Signifikansi Secara Simultan dengan F-test .....	100
6. Uji Koefisien Determinan ( $R^2$ ).....	102

## **BAB V : PEMBAHASAN**

A. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap <i>Return</i> Saham Syariah Perusahaan Industri Sektor Barang Konsumsi di Daftar Efek Syariah (DES) Tahun 2013-2016 .....	103
B. Pengaruh Tingkat Suku Bunga BI <i>Rate</i> terhadap <i>Return</i> Saham Syariah Perusahaan Industri Sektor Barang Konsumsi di Daftar Efek Syariah (DES) Tahun 2013-2016.....	105
C. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah dan Tingkat Suku Bunga BI <i>Rate</i> terhadap <i>Return</i> Saham Syariah Perusahaan Industri Sektor Barang Konsumsi di Daftar Efek Syariah (DES) Tahun 2013-2016 .....	107

## **BAB VI : PENUTUP**

A. Kesimpulan .....	109
B. Saran .....	110

## **DAFTAR RUJUKAN**

## **LAMPIRAN**

## **SURAT PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN /SKRIPSI**

## **DAFTAR RIWAYAT HIDUP**