

## DAFTAR ISI

Halaman Sampul Depan .....	i
Halaman Sampul Dalam .....	ii
Halaman Persetujuan .....	iii
Halaman Pengesahan .....	iv
Motto .....	v
Persembahan .....	vi
Kata Pengantar .....	vii
Daftar Isi .....	x
Daftar Tabel .....	xv
Daftar Gambar .....	xvi
Daftar Lampiran .....	xvii
Abstrak .....	xviii
Abstract .....	xix
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
A. LATAR BELAKANG MASALAH .....	1
B. IDENTIFIKASI MASALAH .....	14
C. RUMUSAN MASALAH .....	14
D. TUJUAN PENELITIAN .....	15
E. KEGUNAAN PENELITIAN .....	16
F. RUANG LINGKUP DAN BATASAN PENELITIAN .....	18
G. PENEGASAN ISTILAH .....	18
H. SISTEMATIKA PEMBAHASAN SKRIPSI .....	20

<b>BAB II LANDASAN TEORI .....</b>	<b>23</b>
<b>A. KAJIAN TEORITIS .....</b>	<b>23</b>
1. Investasi .....	24
2. Pasar Modal Syariah .....	27
a. Konsep dan Definisi Pasar Modal .....	27
b. Pasar Modal Syariah Indonesia .....	30
3. Definisi dan Jenis Saham .....	32
4. Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) .....	36
5. Pembentukan Harga Saham .....	37
6. Indeks Harga Saham .....	40
7. Analisis Harga Saham .....	43
8. Inflasi .....	53
9. <i>BI rate</i> .....	59
10. Kurs .....	61
11. <i>Dow Jones Industrial Average</i> .....	64
<b>B. PENELITIAN TERDAHULU .....</b>	<b>66</b>
<b>C. KERANGKA KONSEPTUAL .....</b>	<b>69</b>
1. Kerangka Pikir Penelitian .....	69
2. Model Pikir Penelitian .....	70
<b>D. KEHADIRAN PENELITI .....</b>	<b>72</b>
<b>E. HIPOTESIS PENELITIAN .....</b>	<b>72</b>

<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>79</b>
A. PENDEKATAN DAN JENIS PENELITIAN .....	79
B. POPULASI, SAMPEL DAN TEKNIK PENGAMBILAN SAMPEL ..	80
1. Populasi Penelitian .....	80
2. Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel .....	82
C. JENIS DAN SUMBER DATA .....	86
D. TEKNIK PENGUMPULAN DATA .....	87
E. INSTRUMEN PENELITIAN .....	88
F. VARIABEL PENELITIAN .....	89
1. Variabel Terikat ( <i>Dependent Variabel</i> ) .....	89
2. Variabel Bebas ( <i>Independent Variabel</i> ) .....	90
G. TEKNIK ANALISIS DATA .....	91
1. Metode Estimasi Model Regresi .....	95
a. <i>Common Effect Model</i> .....	95
b. <i>Fixed Effect Model</i> .....	96
c. <i>Random Effect</i> .....	97
2. Metode Pemilihan Model .....	98
a. Uji Chow ( <i>Chow Test</i> ) .....	98
b. Uji <i>Hausman</i> .....	98
c. Uji <i>Lagrange Multiplier</i> .....	100
3. Uji Asumsi Klasik Data Panel .....	100
a. Uji Linieritas .....	100
b. Uji Normalitas .....	101

c.	Autokorelasi .....	102
d.	Multikolinieritas .....	102
e.	Heteroskedastisitas .....	103
4.	Uji Statistik Analisis Regresi .....	104
a.	Uji T Statistik .....	105
b.	Uji F Statistik .....	106
c.	Uji Koefisien Determinasi ( <i>R Square</i> ) .....	107
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN .....</b>		<b>109</b>
A.	DESKRIPSI DATA .....	109
1.	Deskripsi Harga Saham Sektor Jasa di ISSI .....	111
2.	Deskripsi Inflasi periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	114
3.	Deskripsi Suku Bunga BI <i>rate</i> periode Juni 2011 – Juli 2016 ...	115
4.	Deskripsi <i>Exchange Rate</i> periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	120
5.	Deskripsi DJIA periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	123
B.	PENGUJIAN HIPOTESIS .....	124
1.	Pengujian Model Regresi Data Panel .....	124
a.	Uji <i>Chow</i> .....	124
b.	Uji <i>Hausman</i> .....	125
2.	Uji Asumsi Klasik .....	130
3.	Uji T-Statistik .....	134
4.	Uji F-Statistik .....	139
5.	Koefisien Determinasi ( <i>R Square</i> ) .....	140

<b>BAB V INTERPRETASI HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>142</b>
A. Inflasi Terhadap Harga Saham Sektor Jasa Yang Terdaftar Di ISSI Periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	144
B. Suku Bunga <i>BI Rate</i> Terhadap Harga Saham Sektor Jasa Yang Terdaftar Di ISSI Periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	147
C. Nilai Tukar (USD/IDR) Terhadap Harga Saham Sektor Jasa Yang Terdaftar Di ISSI Periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	150
D. <i>Dow Jones Industrial Average</i> Terhadap Harga Saham Sektor Jasa Yang Terdaftar Di ISSI Periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	153
E. Inflasi, Suku Bunga <i>BI Rate</i> , Nilai Tukar (USD/IDR) dan <i>Dow Jones         Industrial Average</i> Terhadap Harga Saham Sektor Jasa Yang Terdaftar Di ISSI Periode Juni 2011 – Juli 2016 .....	156
<b>BAB VI PENUTUP .....</b>	<b>158</b>
A. Kesimpulan .....	158
B. Saran .....	161
<b>BAGIAN AKHIR .....</b>	<b>163</b>
DAFTAR PUSTAKA .....	163
LAMPIRAN – LAMPIRAN .....	169
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN .....	223
DAFTAR RIWAYAT HIDUP .....	224