DAFTAR ISI

Halaman

JUDUL i
ABSTRAK iii
ABSTRACT iv
LEMBAR PENGESAHAN v
PERNYATAAN ORISINALITAS vi
KATA PENGANTAR vii
DAFTAR ISI ix
DAFTAR LAMPIRAN xii
DAFTAR TABEL xiii
DAFTAR GAMBAR ii
BAB I 1
A. Latar Belakang Masalah 1
B. Perumusan Masalah 9
C. Tujuan Penelitian 9
D. Manfaat Penelitian 10
BAB II 11
A. Kajian Pustaka 11
1. Pasar Modal Syariah dan *Jakarta Islamic Index* (JII) 11
2. Teori Nilai Tukar (Kurs) 16
3. Produk Domestik Bruto 19
4. Harga Emas Dunia 20
5. Harga Minyak Dunia 23
B. Hasil Penelitian Terdahulu 27
C. Kerangka Pemikiran 35
D. Perumusan Hipotesis 40
BAB III 41
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian 41

1. Objek Penelitian 41
2. Ruang Lingkup Penelitian 41
B. Metode Penelitian 41
C. Populasi dan Sampel Penelitian 42
1. Populasi 42
2. Sampel 43
D. Teknik Pengumpulan Data 43
E. Operasionalisasi Variabel 44
F. Teknik Analisis Data 46
BAB IV 53
A. Deskripsi Data 53
B. Uji Stasioner 55
C. Model *Generelized Autoregressive Condotional Heteroscedastisity* (GARCH) dan Pemilihan Model Terbaik 57
D. Uji Asumsi Klasik 59
1. Uji normalitas 59
2. Uji Multikolinearitas 60
3. Uji Autokorelasi 60
E. Analisis Regresi 62
F. Uji Signifikansi Parsial 64
G. Uji Hipotesis 65
1. Uji Hipotesis Pertama 65
2. Uji Hipotesis Kedua 66
3. Uji Hipotesis Ketiga 66
4. Uji Hipotesis Keempat 67
H. Koefisien Determinasi (Adjusted R^2) 68
I. Pembahasan 68
BAB V 72
A. Kesimpulan 72
B. Implikasi 73
C. Saran 73
DAFTAR PUSTAKA 75

DAFTAR LAMPIRAN 79
RIWAYAT HIDUP 89

DAFTAR TABEL

No. Tabel	Judul Gambar	Halaman
Tabel II.1	Ringkasan Penelitian Terdahulu	33
Tabel IV.1	Statistik Variabel Penelitian	53
Tabel IV.2	Uji Stasioner Augmented Dickey Fuller	56
Tabel IV.3	Output Pengujian Metode GARCH	57
Tabel IV.4	Output Persamaan Mean GARCH (1,1)	58
Tabel IV.5	Output Persamaan Variance GARCH (1,1)	58
Tabel IV.6	Output Matriks Uji Multikolinearitas	60
Tabel IV.7	Rangkuman Hasil Penelitian	65
Tabel IV.8	Hasil Hipotesis Pertama	65
Tabel IV.9	Hasil Hipotesis Kedua	66
Tabel IV.10	Hasil Hipotesis Ketiga	67
Tabel IV.11	Hasil Hipotesis Keempat	67

DAFTAR LAMPIRAN

No. Lampiran	Judul Lampiran
Lampiran 1	Nilai Indeks Jakarta Islamic Index (JII)
Lampiran 2	Nilai Tukar (Kurs), Produk Domestik Bruto (PDB), Harga Emas Dunia dan Harga Minyak Dunia
Lampiran 3	Hasil Regresi Berganda dengan Metode GARCH (1,1)
Lampiran 4	Uji Normalitas Uji Jarque-Bera
Lampiran 5	Uji Stasioner Correlogram

DAFTAR GAMBAR

No. Gambar	Judul Gambar	Halaman
Gambar I.1	Jumlah Single Investor Identifier (SID)	1
Gambar I.2	Grafik Dollar Amerika selama 5 tahun	6
Gambar II.1	Kerangka Penelitian	39
Gambar IV.1	Uji Normalitas Uji Jarque-Bera GARCH (1,1)	59
Gambar IV.2	Uji Autokorelasi Correlogram GARCH (1,1)	61
Gambar IV.3	Analisis Regresi Berganda dengan GARCH (1,1)	63