

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Sertifikasi.....	ii
Halaman Pengesahan Tesis.....	iii
Halaman Persembahan	iv
Abstraksi.....	v
Abstract.....	vi
Kata Pengantar.....	vii
Daftar Tabel.....	xii
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Lampiran.....	xiv
Bab I Pendahuluan	1
1.1 Latar belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	15
1.3 Tujuan Penelitian	15
1.4 Manfaat Penelitian	16
Bab II Telaah Pustaka & Pengembangan Model	17
2.1 Telaah Pustaka	17
2.1.1 Arbitrage Pricing Theory	17
2.1.2 Teori Perilaku Keuangan	18
2.1.3 Teori Makroekonomi	19
2.1.4 Sentimen Investor	23
2.1.5 Indeks Saham Syariah Indonesia	24
2.1.6 Prinsip Investasi Syariah.....	24

2.2 Penelitian Terdahulu	27
2.3 Hubungan antar variabel dan Kerangka pemikiran teoritis	37
2.3.1 Pengaruh sentimen investor terhadap indeks harga saham syariah	37
2.3.2 Pengaruh suku bunga terhadap indeks harga saham syariah	39
2.3.3 Pengaruh nilai tukar terhadap indeks harga saham syariah	40
2.3.4 Pengaruh inflasi terhadap indeks harga saham syariah	41
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis	42
2.5 Ringkasan Hipotesis	43
Bab III Metodologi Penelitian	44
3.1 Jenis dan sumber data	44
3.2 Populasi dan sampel	44
3.3 Variabel Penelitian	44
3.3.1 Variabel terikat	45
3.3.2 Variabel bebas	45
3.4 Metode Pengumpulan Data	48
3.5 Metode Analisis Data	48
3.6 Uji Hipotesis	53
Bab IV Analisis & Pembahasan	55
4.1 Analisis Deskriptif	55
4.2 Tahap Analisis Data	57
4.3 Uji Stasioneritas	58
4.4 Estimasi model ARCH-GARCH	59
4.5 Uji Asumsi Klasik	61
4.5.1 Uji Normalitas	61
4.5.2 Uji Multikolinearitas	62

4.5.3 Uji Heteroskedastisitas	63
4.5.4 Uji Autokorelasi	64
4.6 Analisis Regresi Linear	65
4.6.1 Uji F	66
4.6.2 Uji Koefisien Determinasi	66
4.6.3 Uji T	66
4.6.3.1 Hipotesis Pertama	67
4.6.3.2 Hipotesis Kedua	67
4.6.3.3 Hipotesis Ketiga	68
4.6.3.4 Hipotesis Keempat	68
4.7 Ringkasan Hasil Analisis Regresi	69
4.8 Pembahasan Hasil Penelitian	70
4.8.1 Pengaruh Sentimen Investor terhadap Indeks Saham Syariah Indonesia.	70
4.8.2 Pengaruh Suku Bunga terhadap Indeks Saham Syariah Indonesia	73
4.8.3 Pengaruh Nilai Tukar terhadap Indeks Saham Syariah Indonesia	74
4.8.4 Pengaruh Tingkat Inflasi terhadap Indeks Saham Syariah Indonesia	76
4.9 Simulasi Regresi tanpa Variabel Inflasi	78
4.10 Simulasi Regresi tanpa Variabel Suku Bunga	79
Bab V Simpulan & Implikasi Kebijakan	81
5.1 Simpulan	81
5.2 Implikasi Kebijakan	82
5.3 Keterbatasan Penelitian	84
5.4 Agenda Penelitian Mendatang	85
Daftar Referensi	86
Lampiran	89