

## DAFTAR ISI

<b>Halaman Pengesahan.....</b>	<b>ii</b>
<b>Halaman Pernyataan .....</b>	<b>iii</b>
<b>Kata Pengantar.....</b>	<b>iv</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>x</b>
<b>INTISARI.....</b>	<b>xi</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Pertanyaan Penelitian .....	12
1.5 Motivasi Penelitian.....	12
1.6 Manfaat Penelitian.....	14
1.7 Kontribusi Penelitian.....	14
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	16
1.9 Sistematika Penulisan.....	17
<b>BAB II LANDASAN TEORI &amp; TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>18</b>
2.1 Landasan Teori .....	18
2.1.1 Kinerja Pasar Saham Syariah.....	18
2.1.2 Kebijakan Moneter .....	24
2.1.3 Pengaruh Kebijakan Moneter terhadap Indeks Saham Syariah.....	26
2.2 Temuan Terdahulu.....	30
2.3 Hipotesis Penelitian.....	33
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>35</b>
3.1 Desain Penelitian.....	35
3.2 Definisi Operasional Variabel .....	38
3.2.1 Jakarta Islamic Index .....	38
3.2.2 Indikator Kebijakan Moneter.....	39
3.2.3 Variabel Kontrol .....	42

3.3. Populasi dan Sampel.....	45
3.4 Instrumen Penelitian.....	46
3.5 Teknik Pengumpulan Data/Sumber Data .....	47
3.6 Metode Estimasi .....	49
3.6.1 <i>Pre Estimation</i> .....	50
3.6.2 <i>Vector Error Correction Model</i> .....	56
3.6.3 Uji Diagnostik.....	58
3.6.4 Uji Kausalitas Granger.....	60
3.6.5 Uji <i>Impulse Response Function</i> .....	61
3.6.6 Uji <i>Forecast Error Variance Decomposition</i> .....	62
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>65</b>
4.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	65
4.2 <i>Pre Estimation</i> Analisis.....	68
4.2.1 Hasil <i>Unit root test</i> .....	68
4.2.2 Hasil Uji Lag Optimum .....	70
4.2.3 Hasil Uji Kointegrasi .....	71
4.3 Analisis Hasil Estimasi Vector Error Correction Model (VECM).....	73
4.3.1 Analisis VECM Jangka Pendek.....	73
4.3.2 Analisis VECM Jangka Panjang.....	76
4.4 Uji Diagnostik .....	83
4.4.1 Hasil Uji Autokorelasi .....	83
4.4.2 Hasil Uji Normalitas .....	84
4.4.3 Hasil Uji Stabilitas .....	86
4.4.3 Hasil Uji Multikolinearitas .....	89
4.5 Uji Kausalitas Granger : Wald Test.....	90
4.6 Analisis Hasil <i>Uji Impulse Response Function (IRF)</i> .....	93
4.7 Analisis Hasil Uji <i>Forecast Error Variance Decomposition (FEVD)</i> .....	97
<b>BAB V KESIMPULAN.....</b>	<b>103</b>
5.1 Kesimpulan.....	103
5.2 Implikasi Penelitian.....	105
5.3 Keterbatasan Penelitian & Rekomendasi Penelitian Lanjutan .....	107
<b>Daftar Pustaka.....</b>	<b>108</b>
<b>Lampiran .....</b>	<b>116</b>