

## ABSTRAK

Nama: **Fauziah**, NIM: 111400730, judul skripsi *Pengaruh Nilai Tukar Rupiah Terhadap Pergerakan Indeks Harga Saham Syariah Di Jakarta Islamic Index (Jii) Tahun 2013-2017*.

Sebagaimana diketahui bahwa tingkat nilai tukar secara periodik akan selalu berfluktuasi dan fluktuasi tingkat nilai tukar tersebut akan berpengaruh terhadap pergerakan indeks saham di bursa efek. Maka hal ini akan berdampak pada perusahaan sehingga pembagian laba kepada pemegang saham (*dividen*) menjadi berkurang, kondisi ini memaksa permintaan atas saham menurun dan mempengaruhi harga saham, terutama pada saham-saham syariah pada *Jakarta Islamic index (JII)*.

Dari uraian latar belakang tersebut, maka diperoleh perumusan masalah dalam penelitian ini adalah bagaimanakah nilai tukar rupiah berpengaruh terhadap pergerakan indeks harga saham syariah di Jakarta Islamic index (JII)? Seberapa besarkah pengaruh nilai tukar rupiah terhadap pergerakan indeks harga saham syariah di Jakarta Islamic index (JII)?

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui bagaimanakah nilai tukar rupiah berpengaruh terhadap pergerakan indeks harga saham syariah di Jakarta Islamic index (JII) dan Seberapa besarkah pengaruh nilai tukar rupiah terhadap pergerakan indeks harga saham syariah di Jakarta Islamic index (JII).

Metodologi penelitian yang digunakan pada penelitian kali ini adalah analisis deskriptif, uji asumsi klasik meliputi uji normalitas, uji t, uji F, dan uji heterokedastisitas dan koefisien determinasi. Dari hasil penelitian tersebut Pada hasil regresi analisis data menunjukkan variabel nilai tukar rupiah terhadap indeks harga saham syariah menunjukkan nilai signifikansi sebesar 0,000. Dilihat dari nilai signifikansi tersebut berarti lebih kecil daripada 0,05. Dengan nilai t hitung sebesar -4,422 dan nilai t tabel sebesar 3,466. Hal ini menunjukkan bahwa nilai t hitung < t tabel. Maka  $H_0$  diterima dan  $H_a$  ditolak atau dikatakan tidak signifikan yang artinya secara parsial variabel nilai tukar rupiah tidak berpengaruh signifikan terhadap variabel indeks harga saham syariah di Jakarta Islamic index (JII). Sedangkan berdasarkan uji simultan nilai F hitung > F tabel (19,558 > 4,01) maka hal itu menunjukkan secara simultan variabel nilai tukar rupiah berpengaruh signifikan terhadap variabel indeks harga saham syariah. Namun berbeda dengan uji koefisien determinasi yang menunjukkan adanya pengaruh nilai tukar rupiah terhadap indeks harga saham syaria *JII* sebesar 25,5%.

Berdasarkan uji autokorelasi dalam penelitian ini menunjukkan tidak adanya autokorelasi karna terlihat nilai ( $d < d < 4-d$ ) yakni sebesar  $1,6134 < 1,765 < 2,3866$ .

*Keyword* : Nilai Tukar Rupiah, Indeks Harga Saham Syariah