PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

Saya menyatakan bahwa skripsi yang saya tulis diajukan pada Jurusan Perbankan Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam, Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten adalah salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Ekonomi. Skripsi ini merupakan hasil karya tulis ilmiah saya pribadi, sepenuhnya asli.

Adapun pendapat orang lain yang ada di skripsi ini, saya sudah cantumkan kutipannya secara jelas dan sesuai dengan etika keilmuan yang ada di bidang penulisan karya imiah. Saya bersedia untuk menerima sanksi berupa pencabutan gelar sarjana yang saya terima atau sanksi akademik lain sesuai dengan peraturan yang berlaku apabila sebagian atau seluruh skripsi ini adalah hasil plagiarisme atau mencontek karya

Serang, 17 Maret 2022

Jaenudin Sukron
NIM: 181420092

ABSTRAK

Nama: Jaenudin Sukron, NIM: 181420092, Judul Skripsi: *Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020.*

Penelitian ini dilatarbelakangi oleh fenomena peningkatan jumlah investor di pasar modal indonesia sepanjang tahun 2020. Menurut data yang dirilis oleh Bursa Efek Indonesia (BEI), terjadi peningkatan jumlah investor di pasar modal sebanyak 56%. Penggunaaan sistem SOTS juga mengalami peningkatan mencapai 93,870 investor per maret 2021. Jumlah tersebut mengalami kenaikan sebanyak 19 kali lipat selama 5 tahun terakhir. Jumlah investor di pasar modal syariah berjumlah 4,908 pada 2015.

Rumusan masalah penelitian ini adalah:1)Bagaimana pengaruh PBV, PER, ROA, dan DER terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020 secara simultan? 2)Bagaimana pengaruh PBV terhadap harga sahamperusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020? 3)Bagaimana pengaruh PER terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020? 4)Bagaimana pengaruh ROA terhadap harga saham yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020?5)Bagaimana pengaruh DER terhadap harga saham yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020?

Tujuan penelitian ini yaituuntuk mengetahui pengaruh *Price to Book Value* (PBV), *Price to Earning Ratio* (PER), *Return On Assets* (ROA), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) periode 2016-2020 seacara simultan dan secara parsial.

Penelitian ini menggunakan metode analisis regresi linear berganda. Metode regresi linear berganda digunakan untuk mengetahui pengaruh beberapa variabel bebas (X) terhadap variabel terikat (Y). Objek penelitian ini yaitu Jakarta Islamic Index (JII). Pengambilan sampel penelitian ini menggunakan *purposive sampling* dengan menenutukan beberapa kriteria sehingga didapatkanlah 11 perusahaan atau emiten yang menjadi sampel penelitian.

Kesimpulan yang didapat dari penelitian ini adalah PBV, PER, ROA dan DER berpengaruh terhadap harga saham secara simultan. Hasil tersebut didapat dengan membandingakan F hitung =21,315 > F tabel=2,56 dan nilai signifikansi 0,000 < 0,05. Maka dapat disimpulkan bahwa PBV, PER, ROA, dan DER secara simultan berpengaruh terhadap harga saham. Nilai *R Square*=0,630 yang berarti variabel PBV, PER, ROA, dan DER mempengaruhi variabel harga saham sebesar 63%. Sedangkan sisanya 37% harga saham dipengaruhi oleh faktor–faktor lain diluar penelitian ini. Hasil uji secara parsial, hanya variabel *Price to Book Value* (PBV) dan *Debt to Equity Ratio* (DER) yang berpengaruh terhadapharga saham. Sedangkan variabel *Price to Earning Ratio* (PER) dan *Return On Assets* (ROA) tidak berpengaruh terhadap harga saham.

Kata Kunci: PBV, PER, ROA, DER, Harga Saham, Investasi Syariah

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SULTAN MAULANA HASANUDDIN BANTEN
Jl. Jend. Sudirman No.30 Serang, Banten 42118 Telp. +62254 200323
Fax +62252 200022

Nomor : NOTA DINAS
Lampiran : 1 (Satu) eksemplar
Hal : **Usulan Munaqasyah a.n Jaenudin Sukron NIM: 181420092**

Kepada Yth.
Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN SMH Banten
di –
Serang

Assalamua'alaikum Wr. Wb

Dipermaklumkan dengan hormat bahwa setelah membaca dan mengadakan perbaikan seperlunya, maka kami berpendapat bahwa skripsi saudara Jaenudin Sukron, NIM: 181420092 dengan judul skripsi ***"Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020",*** Sudah layak untuk diajukan dalam Ujian Munaqasyah pada Jurusan Perbankan Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sultan Maulana Hasanuddin Banten.

Demikian, atas perhatian ibu, kami ucapkan terimakasih.

Wassalamua'alaikum Wr. Wb

Serang, 5 April 2022

Pembimbing I

Dr. Wazin, M.S.I.
NIP: 196302251990031005

Pembimbing II

Fitri Raya, M.Ek.
NIP: 198808102019032010

PERSETUJUAN

PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) PERIODE 2016-2020

Oleh:

Jaenudin Sukron
NIM: 181420092

Menyetujui,

Pembimbing I	**Pembimbing II**
Dr. Wazin, M.S.I.	Fitri Raya, M.Ek.
NIP: 196302251990031005	NIP: 198808102019032010

Mengetahui,

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam	**Ketua Jurusan Perbankan Syariah**
Dr. Hj. Nihayatul Masykuroh, M.SI.	Hendrieta Ferieka, S.E., MSi.
NIP: 196402121991032003	NIP: 198306112006042001

PERSEMBAHAN

Skripsi ini penulis persembahan untuk orang-orang yang telah berjasa bagi diri pribadi penulis, yaitu:

1. Kedua orangtuaku Bapak H. Joharuddin (ALM) dan Ibu Jalihah yang senantiasa memberikan kasih sayang dari kecil hingga dewasa ini.
2. Kakakku Jaed Imron yang telah memberikan *support* dan semagat yang luar biasa hingga bisa menyelesaikan tugas akhir berupa skripsi ini.
3. Adikku Johanah yang selalu memberikan doa dan semangat.
4. Bapak H. S. Suhaedi (Pak Uus) selaku pembina tim tenis meja UIN Banten dan sahabat-sahabatku di tim tenis meja UIN Banten yang telah memberikan *support* dalam menyelesaikan skripsi ini.
5. Ibu Ida yangtelah memeberikan semangat dan arahan agar dapat menyelesaikan kuliah tepat waktu.
6. Sahabat-sahabat kelas PBS C yang telah membantu dan memberikan support kepada penulis.
7. Sahabat-sahabat tongkrongan Lab FEBI (Nurul, Ilma, Ipat, Nami, dll) yang telah membantu dan memberikan *support* kepada penulis.
8. Untuk Sahabat pingpong tiga skandal yaitu bung riki dan nyai anisa.

PENGESAHAN

Skripsi a.n. Jaenudin Sukron dengan NIM: 181420092 yang berjudul: ***"Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020",*** telah diujikan dalam sidang Munaqasyah Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten pada tanggal 18 Mei Tahun 2022. Skripsi ini telah diterima sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar sarjana program strata satu (S1) pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam Jurusan Perbankan Syariah Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten.

Sidang Munaqasyah

Ketua Merangkap Anggota	Sekretaris merangkap anggota
Dr. Hj. Nihayatul Masykuroh, M.SI.	**Ma'mun Nawawi, M.E.**
NIP: 196402121991032003	**NIP: 199303022019031009**

Anggota-Anggota

Penguji I	Penguji II
Rustamunadi, S.H., M.H.	**Henny Saraswati, M.M.**
NIP: 196709241989031001	**NIP: 198511172019032013**

Pembimbing I	Pembimbing II
Dr. Wazin, M.S.I.	**Fitri Raya, M.Ek.**
NIP: 196302251990031005	**NIP: 198808102019032010**

MOTTO

"Maka barangsiapa mengerjakan kebaikan sebesar biji zarrah,
niscaya dia akan melihat balasannya."

(QS. Az-Zalzalah Ayat 7)

RIWAYAT HIDUP

Penulis bernama lengkap Jaenudin sukron, putra dari Bapak H. Joharuddin (ALM) dan Ibu Jalihah. Penulis merupakan anak kedua dari 3 bersaudara. Riwayat pendidikan penulis yaitu SDN cirunten, kemudian melanjutkan pendidikan di SMPN 1 Anyar, kemudian melanjutkan pendidikan di SMA Negeri 1 Anyer, kemudian menempuh Studi Strata 1 (S1) di Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten Prodi Perbankan Syariah pada tahun 2018.

Selama berkuliah, penulis mengikuti organisasi intra kampus yaitu Himpunan Mahasiswa Jurusan (HMJ) Perbankan Syariah masa kepengurusan 2019. Selain itu, penulis juga tergabung dengan tim tenis meja UIN Banten untuk mewakili kampus dalam event-event pertandingan antar kampus maupun kejuaraan umum. Raihan selama bergabung dengan tim tenis meja UIN Banten, penulis pernah mendapat medali perunggu dalam ajang PIONIR 2019 (PTKIN se-nasional) cabang olahraga tenis meja nomor ganda putra dan medali perak pada ajang IPPBMM 2021(PTKIN se-Jawa dan Madura) cabang olahraga tenis meja nomor ganda putra.

KATA PENGANTAR

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Puji syukur kehadirat Allah SWT yang telah meberikan rahmat dan karunianya untuk kita yang masih diberi nikmat iman dan Islam serta nikmat sehat jasmani maupun rohani. Sholawat dan salam kepada Baginda Nabi Muhammad SAW, yang menjadi suri taulan bagi kita.

Alhamdulilllah berkat usaha dengan diiringi doa, Akhirnya penulis dapat membuat karya ilmiah berupa skripsi yang berjudul***"Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2020".***

Penulis mengucapkan terimakasih kepada berbagai pihak yang telah membantu penyusunan skripsi ini, diantaranya:

1. Bapak Prof. Dr. H. Wawan Wahyudin, M.Pd., Rektor Universitas Islam Negeri Sultan Maulana Hasanuddin Banten.
2. Ibu Dr. Hj. Nihayatul Masykuroh, M.SI., Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sultan Maulana Hasanuddin Banten.
3. Ibu Hendrieta Ferieka, S.E., M.Si., Ketua Jurusan Perbankan Syariah.
4. Bapak Dr. Wazin, M.S.I., selaku dosen pembimbing I yang telah memberikan arahan, bimbingan, serta saran dalam penyusunan skripsi ini.

5. Ibu Fitri Raya, M.Ak, Selaku dosen pembimbing II yang telah memberikan arahan, bimbingan, serta saran dalam penyusunan skripsi ini.
6. Bapak/Ibu seluruh dosen, staff, dan pegawai Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam yang sudah membantu baik secara langsung maupun tidak langsung dalam proses penulisan skripsi ini.
7. Kepada teman-teman yang telah membantu dalam penyusunan skripsi ini.

Penulis mohon maaf jika masih banyak kekurangan dalam penulisan karya ini, karena penulis sendiri masih dalam tahap pembelajaran. Semoga karya ini dapat bermanfaat khususnya bagi penulis dan para pembaca.

Wassalamu'alaikum Wr.Wb.

Serang, 5 April 2022

Penulis,

Jaenudin Sukron

NIM: 181420092

DAFTAR ISI

PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI ..... **Error! Bookmark not defined.**
ABSTRAK ii
NOTA DINAS ..... **Error! Bookmark not defined.**
PERSETUJUAN ..... **Error! Bookmark not defined.**
PERSEMBAHAN v
MOTTO vi
RIWAYAT HIDUP viii
KATA PENGANTAR ix
DAFTAR GAMBAR xiii
DAFTAR TABEL xiv
BAB I PENDAHULUAN ..... **Error! Bookmark not defined.**
A. Latar Belakang Masalah ..... **Error! Bookmark not defined.**
B. Identifikasi Masalah ..... **Error! Bookmark not defined.**
C. Pembatasan Masalah ..... **Error! Bookmark not defined.**
D. Perumusan Masalah ..... **Error! Bookmark not defined.**
E. Tujuan Penelitian ..... **Error! Bookmark not defined.**
F. Manfaat Penelitian ..... **Error! Bookmark not defined.**
G. Sistematika Pembahasan ..... **Error! Bookmark not defined.**
BAB II TINJAUAN PUSTAKA ..... **Error! Bookmark not defined.**
A. Landasan Teori ..... **Error! Bookmark not defined.**
1. Investasi Syariah ..... **Error! Bookmark not defined.**
2. Pasar Modal Syariah ..... **Error! Bookmark not defined.**
3. JII (Jakarta Islamic Index) ..... **Error! Bookmark not defined.**
4. Laporan Keuangan ..... **Error! Bookmark not defined.**
5. *Fundamental Analysis* (Analisis Fundamental) ..... **Error! Bookmark not defined.**
6. Analisis Rasio ..... **Error! Bookmark not defined.**
B. Penelitian Terdahulu ..... **Error! Bookmark not defined.**
C. Kerangka Berpikir ..... **Error! Bookmark not defined.**

D. Hubungan Antar Variabel dan Hipotesis ..... **Error! Bookmark not defined.**
BAB III METODE PENELITIAN..... **Error! Bookmark not defined.**
A. Populasi dan Sampel..... **Error! Bookmark not defined.**
B. Waktu dan Tempat Penelitian ..... **Error! Bookmark not defined.**
C. Jenis Metode Penelitian ..... **Error! Bookmark not defined.**
D. Teknik Pengumpulan Data..... **Error! Bookmark not defined.**
E. Teknik Analisis Data ..... **Error! Bookmark not defined.**
F. Regresi Linear Berganda..... **Error! Bookmark not defined.**
G. Perangkat Alat Uji ..... **Error! Bookmark not defined.**
1. Uji Asumsi Klasik..... **Error! Bookmark not defined.**
2. Uji Statistik F..... **Error! Bookmark not defined.**
3. Uji Statistik T ..... **Error! Bookmark not defined.**
4. Uji Koefisien Determinasi (R^2) ..... **Error! Bookmark not defined.**
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN ..... **Error! Bookmark not defined.**
A. Gambaran Umum Objek Penelitian..... **Error! Bookmark not defined.**
B. Analisis Data ..... **Error! Bookmark not defined.**
1. Analisis Deskriptif ..... **Error! Bookmark not defined.**
2. Uji Asumsi Klasik..... **Error! Bookmark not defined.**
3. Regresi Linear Berganda..... **Error! Bookmark not defined.**
4. Pengujian Hipotesis ..... **Error! Bookmark not defined.**
C. Pembahasan..... **Error! Bookmark not defined.**
BAB V PENUTUP..... **Error! Bookmark not defined.**
A. Kesimpulan ..... **Error! Bookmark not defined.**
B. Saran..... **Error! Bookmark not defined.**
DAFTAR PUSTAKA ..... **Error! Bookmark not defined.**
LAMPIRAN-LAMPIRAN ..... **Error! Bookmark not defined.**

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1 Kerangka Berpikir.....**Error! Bookmark not defined.**
Gambar4. 1 Perkembangan Harga Saham.....**Error! Bookmark not defined.**

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Neraca betuk skontro .....**Error! Bookmark not defined.**
Tabel 2. 2 Neraca bentuk stafel .....**Error! Bookmark not defined.**
Tabel 2. 3 Penelitian Terdahulu .....**Error! Bookmark not defined.**
Tabel 3. 1 Daftar Sampel.....**Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 1 *Price to Book Value* (kali) ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 2 *Price to Earning Ratio* (kali) ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 3 *Return On Assets* (Presentase) ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 4 *Debt to Equity Ratio* (kali)..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 5 Harga Saham (Rupiah) ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 6 Uji Normalitas..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 7 Uji Heterokedastisitas..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 8 Uji Multikolonieritas ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 9 Uji Autokorelasi ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 10 Regresi Linear Berganda ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 11 Uji t ..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 12 Uji F..... **Error! Bookmark not defined.**
Tabel 4. 13 Uji Koefisien Determinasi ..... **Error! Bookmark not defined.**