

DAFTAR ISI

Halaman

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	i
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan dan Manfaat penelitian	10
1.3.1 Tujuan Penelitian	10
1.4 Manfaat Penelitian	10
1.5 Sistematika Penulisan	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1 Arbitrage Pricing Theory (APT).....	13
2.2 <i>signaling theory</i> (Teori Sinyal).....	13
2.3 Pecking Order Theory.....	15
2.4 Pasar Modal	16
2.4.1 Sejarah Pasar Modal Syariah	16

2.4.2	Konsep Dasar Keuangan Syariah	17
2.4.3	Pengertian Investasi	17
2.4.4	Tujuan Investasi	22
2.5	Pengertian Saham	23
2.5.1	Saham Syariah	25
2.6	<i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	26
2.6.1	Prinsip Saham Syariah	27
2.7	Instrumen Pasar Modal Yang Diharamkan Syariah	29
2.8	Return Saham	30
2.9	Analisis Fundamental	31
2.9.1	Return on Equity (ROE)	32
2.9.2	Debt to Equity Ratio (DER)	33
2.9.3	Current Ratio (CR)	33
2.9.4	Price to Book Value (PBV)	34
2.10	Penelitian-Penelitian Terdahulu	34
2.11	Pengaruh Variabel Independen Terhadap Variabel Dependen	39
2.11.1	Pengaruh <i>Return On Equity (ROE)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	39
2.11.2	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Dengan <i>Return Saham</i>	40
2.11.3	Pengaruh <i>Current Ratio (CR)</i> Dengan <i>Return Saham</i>	41
2.11.4	Pengaruh <i>Price to Book Value (PBV)</i> Dengan <i>Return Saham</i>	42
2.12	Kerangka Pemikiran	43
2.13	Hipotesis Penelitian	44
BAB III METODE PENELITIAN		45
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	45

3.1.1	Variabel Penelitian.....	45
3.1.2	Definisi Operasional Variabel	46
3.1.2.1	Variabel Independen.....	46
3.1.2.2	Variabel Dependen	47
3.1.2.3	Return Saham.....	47
3.2	Populasi dan Sampel.....	48
3.2.1	Populasi	48
3.2.2	Sampel	49
3.3	Sumber dan Jenis Data.....	50
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	51
3.5	Metode Analisis	51
3.5.1	Pengujian Regresi Linear Berganda	51
3.5.2	Pengujian Asumsi Klasik.....	53
3.5.2.1	Uji Normalitas	53
3.5.2.2	Uji Multikolinierlitas	53
3.5.2.3	Uji Autokorelasi	54
3.5.2.4	Uji Heteroskedastisitas	55
3.6	Uji Hipotesis	55
3.6.1	Pengujian Signifikan Simultan (Uji F)	56
3.6.2	Uji Koefisien Regresi Parsial (Uji t).....	56
3.6.3	Analisis Koefisien Determinasi (R ²).....	57
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		58
4.1	Deskripsi Objek Penelitian	58
4.2	Statistik Deskriptif	59

4.3 Uji Asumsi Klasik.....	61
4.3.1 Uji Normalitas	62
4.3.2 Uji Multikolonieritas	64
4.3.3 Uji Heterokedastisitas	65
4.3.4 Uji Autokorelasi.....	66
4.4 Analisis Regresi Berganda.....	67
4.5 Uji Hipotesis	68
4.5.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	68
4.5.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	69
4.5.3 Uji Parsial (Uji Statistik t)	69
4.6 Pembahasan	72
BAB V PENUTUP	75
5.1 Kesimpulan	75
5.2 Keterbatasan Penelitian	76
5.3 Saran	76
Daftar Pustaka	78
Lampiran A Daftar Perusahaan Sampel	82
Lampiran B Tabulasi Data.....	83
Lampiran C Hasil Analisis Regresi	87