DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL i

HALAMAN PERSETUJUAN ii

HALAMAN PERNYATAAN iii

HALAMAN PENGESAHAN iv

ABSTRAKSI v

MOTTO DAN PERSEMBAHAN vi

KATA PENGANTAR vii

DAFTAR ISI..... ix

DAFTAR TABEL xiv

DAFTAR GAMBAR xvi

I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang 1

1.2 Rumusan Masalah 8

1.3 Tujuan Penelitian 8

1.4 Manfaat Penelitian 9

II TINJAUAN PUSTAKA

2.1 Pasar Modal 10

2.1.1 Pasar Modal Syariah 11

2.2 Jakarta Islamic Index 12

2.3 Return Saham Syariah 13

2.4 Perbedaan pasar Modal Syariah dan Konvensional 15

2.5 Rasio Lancar (*Current Ratio*) 16

2.5.1 Komponen Rasio Lancar 17

2.5.2 Hubungan antara Current Ratio Dengan Return Saham Syariah 21
2.6 *Debt to Equity Ratio* 22
2.5.1 Pengaruh DER terhadap Return Saham 23
2.7 Pengertian *Price Earning Ratio* 24
2.6.1 Pengaruh PER terhadap Return Saham 25
2.7 Model Empirik 26

III METODE PENELITIAN

3.1 Jenis Penelitian 27
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian 27
3.2.1 Populasi Penelitian 27
3.2.2 Sampel Penelitian 28
3.3 Sumber dan Metode Pengumpulan Data 28
3.4 Variabel dan Indikator 29
3.5 Metode Analisis Data 30

IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Obyek Penelitian 36
4.2 Deskriptif Variabel Penelitian 38
4.2.1 *Current Ratio* 38
4.2.2 *Debt to Equity Ratio* 41
4.2.3 *Price Earning Ratio* 43
4.2.4 *Return* Saham 45
4.3 Uji Asumsi Klasik 47
4.4 Model Persamaan Regresi Berganda 48
4.5 Pengujian Hipotesis 49

4.6 Koefisien Determinasi 52
4.7 Uji F 52
4.8 Pembahasan 54
4.8.1 Pengaruh *Current Ratio* Terhadap Return Saham 54
4.8.2 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap Return Saham . 55
4.8.3 Pengaruh *Price Earning Ratio* Terhadap Return Saham .. 56

V PENUTUP

5.1 Kesimpulan 57
5.2 Keterbatasan 58
5.3 Saran dan Agenda Penelitian Yang Akan Datang 58

DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Halaman

Tabel 3.1 Definisi Operasional Variabel 27

Tabel 4.1 Distribusi Sampel 34

Tabel 4.2 Sampel Penelitian 35

Tabel 4.3 Deskripsi Variabel 36

Tabel 4.4 *Current Ratio* 37

Tabel 4.5 *Debt to Equity Ratio* 38

Tabel 4.6 *Price Earning Ratio* 40

Tabel 4.7 *Return Saham* 42

Tabel 4.8 One Sampel Kolmogorov Smirnov Test 44

Tabel 4.9 Uji Multikolinearitas 45

Tabel 4.10 Hasil Perhitungan Uji Gletjer 47

Tabel 4.11 Model Persamaan Regresi 48

Tabel 4.12 Model Summary 52

Tabel 4.13 Uji F 53

DAFTAR GAMBAR

Halaman

Gambar 2.1 Kerangka Pikir 24

Gambar 4.1 Normalitas 43

Gambar 4.2 Hasil Analisis Grafik Uji Heteroskedastisitas 46

Gambar 4.3 Hasil Pengujian Durbin Watson 48

Gambar 4.4 Penagruh *Current Ratio* Terhadap Return Saham 50

Gambar 4.5 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap Return Saham 51

Gambar 4.6 Penagruh *Price Earning Ratio* Terhadap Return Saham 52