

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
ABSTRAK	v
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR TABEL	xv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Signalling Theory	9
2.2 Pengertian Pasar Modal Syariah dan Jakarta Islamic Index (JII) .	10

2.3 Pengertian Saham Syariah	12
2.4 Pengertian Return Saham	13
2.5 Pengertian Rasio Keuangan	14
2.5.1 Total Assets Turnover (TATO)	14
2.5.2 Return On Assets (ROA)	15
2.5.3 Return On Equity (ROE)	16
2.5.4 Current Ratio	17
2.5.5 Debt to Equity Ratio (DER)	18
2.5.6 Earning Per Share (EPS)	19
2.6 Penelitian Terdahulu	20
2.7 Hubungan Faktor Fundamental dengan Return Saham	22
2.7.1 Pengaruh Total Assets Turnover Terhadap Return Saham	22
2.7.2 Pengaruh Return On Assets Terhadap Return Saham	23
2.7.3 Pengaruh Return On Equity Terhadap Return Saham	24
2.7.4 Pengaruh Current Ratio Terhadap Return Saham	25
2.7.5 Pengaruh Debt to Equity Ratio Terhadap Return Saham	25
2.7.6 Pengaruh Earning Per Share Terhadap Return Saham	26
2.8 Kerangka Pemikiran Teoritis	27

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Jenis Penelitian	29
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian	29
3.3 Jenis dan Sumber Data	29
3.4 Metode Pengumpulan Data	30

3.5 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Penelitian	30
3.5.1 Variabel Penelitian	30
3.5.2 Definisi Operasional Variabel	30
3.5.2.1 Return Saham	31
3.5.2.2 Total Assets Turnover (TATO)	31
3.5.2.3 Return On Assets (ROA)	32
3.5.2.4 Return On Equity (ROE)	32
3.5.2.5 Current Ratio (CR)	32
3.5.2.6 Debt Equity Ratio (DER)	33
3.5.2.7 Earning Per Share (EPS)	33
3.6 Teknik Analisis Data	33
3.6.1 Statistik Deskriptif	33
3.6.2 Uji Normalitas	34
3.6.3 Uji Asumsi Klasik	34
3.6.3.1 Uji Autokorelasi	34
3.6.3.2 Uji Heterokedasitas	35
3.6.3.3 Uji Multikolinearitas	35
3.6.4 Analisis Regresi Berganda	36
3.6.5 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	37
3.6.6 Uji Simultan (Uji F)	37
3.6.7 Uji Hipotesis (Uji t)	38

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskripsi Obyek Penelitian	39
--------------------------------------	----

4.2 Analisis Data	40
4.2.1 Statistik Deskriptif	40
4.2.2 Uji Asumsi Klasik	41
4.2.2.1 Uji Normalitas	41
4.2.2.2 Uji Autokorelasi	43
4.2.2.3 Uji Multikolinieritas	44
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas	45
4.2.3 Pengujian Hipotesis dengan Regresi Berganda	47
4.2.3.1 Pengujian Hipotesis Secara Parsial	50
4.2.3.2 Pengujian Hipotesis Secara Simultan	52
4.2.3.3 Koefisien Determinasi Ganda (R^2)	53
4.3 Pembahasan	54

BAB V PENUTUP

5.1 Kesimpulan	60
5.2 Saran	61
5.3 Keterbatasan Penelitian dan Agenda Penelitian Mendatang ...	61

DAFTAR PUSTAKA	xvi
-----------------------------	------------