

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN BIMBINGAN SKRIPSI	ii
PENEGSAHAN MUNAQOSYAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR TABEL	xv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	9
E. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori	11
1. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	11
2. <i>Return Saham</i>	16
3. Analisis Rasio Keuangan.....	18
4. <i>Current Ratio (CR)</i>	21
5. <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	23
6. <i>Net Profit Margin (NPM)</i>	24
B. Penelitian Terdahulu	26
C. Kerangkaberfikir	31
D. Hipotesis	31
1. Pengaruh <i>Current Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	31
2. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	32
3. Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	34
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian	36
B. <i>Setting</i> Penelitian dan Sumber Data	36
C. Populasi dan Sampel.....	37

D. Desain dan Definisi Operasional Variabel.....	39
E. Teknik Pengumpulan Data	42
F. Teknik Analisis Data	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian.....	52
1. Gambaran Objek Penelitian.....	52
a. ADES (PT Akasha Wira International Tbk)	52
b. CAMP (PT Campina Ice Cream Industry Tbk).....	53
c. CLEO (PT Sariguna Primatirta Tbk)	53
d. DSFI (PT Dharma Samudera Fishing Industries Tbk).....	54
e. JPFA (PT Japfa Comfeed Indonesia Tbk)....	55
f. KINO (PT Kino Indonesia Tbk).....	55
g. MBTO (PT Martiina Berto Tbk).....	56
h. MRAT (PT Mustikaratu Tbk)	57
i. MYOR (PT Mayora Indah Tbk).....	58
j. ROTI (PT Nippon Indosari Corporindo Tbk).....	58
k. SIDO (PT Industri Jamu dan Farmasi Sido Muncul Tbk).....	59
l. SIMP (PT Salim Ivomas Pratama Tbk).....	60
m. SKBM (PT Sekar Bumi Tbk).....	61
n. STTP (PT Siantar Top Tbk).....	62
o. TCID (PT Mandom Indonesia Tbk).....	63
p. ULTJ (PT Ultra Jaya Milk Industry & Trading Company Tbk).....	63
q. UNVR (PT Unilever Indonesia Tbk)	64
2. Analisis Data	65
a. Analisis Statistik Deskriptif	65
b. Estimasi Model Regresi Data Panel.....	68
c. Pemilihan Model Regresi Data Panel	71
d. Uji Asumsi Klasik.....	74
e. Analisis Regresi Data Panel.....	77
f. Uji Hipotesis	79
B. Hasil Pembahasan	82
1. Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	82
2. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	84

3. Pengaruh *Net Profit Margin* terhadap *Return Saham*..... 85

BAB V PENUTUP

A. Kesimpulan 87

B. Saran 87

DAFTAR PUSTAKA



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Perkembangan Saham Syariah 2
Gambar 1.2. Tingkat Return Saham 4
Gambar 2.1 Kerangka Penelitian..... 31
Gambar 4.1 *Uji Normalitas* 74



DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1 Hasil Statistik Deskriptif	66
Tabel 4. 2 Hasil Common Effect Model	69
Tabel 4. 3 Hasil Fixed Effect Model.....	70
Tabel 4. 4 Hasil Random Effect Model	71
Tabel 4. 5 Hasil Uji Chow.....	72
Tabel 4. 6 Hasil Uji Lagrange Multiplier (LM)	73
Tabel 4. 7 Uji Multikolineritas	75
Tabel 4. 8 Uji Heteroskedastisitas.....	76
Tabel 4. 9 Uji Autokorelasi	77
Tabel 4. 10 Hasil Regresi Data Panel.....	77
Tabel 4. 11 Uji Koefisien Determinasi	79
Tabel 4. 12 Uji F	80
Tabel 4. 13 Uji t.....	81

