

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	12
C. Tujuan Penelitian	12
D. Manfaat Penelitian	12
E. Sistematikan Penulisan	13
BAB II LANDASAN TEORI	15
A. Deskripsi Teori	15
1. Teori Sinyal	15
2. <i>Return</i> Saham	15
3. Kinerja Keuangan	16
4. Rasio Keuangan	17
5. Saham Syariah	22
B. Penelitian Terdahulu	23
C. Kerangka Berpikir	31
D. Hipotesis	31
BAB III METODE PENELITIAN	39
A. Jenis dan Pendekatan	39
B. Lokasi/Objek Penelitian	39
C. Populasi dan Sampel	39
D. Identifikasi Variabel	41
E. Definisi Operasional	41
F. Teknik Pengumpulan Data	44
G. Teknik Analisis Data	45

BAB IV HASIL PENELITIAN	51
A. Jakarta Islamic Index	51
B. Hasil Penelitian	52
1. Analisis Statistik Deskriptif	52
2. Analisis Regresi Data Panel	54
3. Uji Aumsi Klasik	62
4. Hasil Uji Hipotesis	66
C. Pembahasan	70
BAB V PENUTUP	78
A. Kesimpulan	78
B. Saran	78
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik Rata-rata *Return Saham* 3
Gambar 1.2 Grafik Rata-rata *Debt to Equity Ratio* 4
Gambar 1.3 Grafik Rata-rata *Current Ratio* 6
Gambar 1.4 Grafik Rata-rata *Return On Assets* 8
Gambar 1.5 Grafik Rata-rata *Return On Equity* 10
Gambar 2.1 Bagan Kerangka Berfikir..... 23



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	23
Tabel 3.1 Klasifikasi Sampel Perusahaan	40
Tabel 3.2 Daftar Sampel Perusahaan	41
Tabel 4.1 Hasil Uji Analisis Statistik Deskriptif	53
Tabel 4.2 Common Effect Model	55
Tabel 4.3 Fixed Effect Model	56
Tabel 4.4 Random Effect Model	57
Tabel 4.5 Hasil Uji Chow	59
Tabel 4.6 Hasil Uji LM	60
Tabel 4.7 Hasil Uji Regresi Panel	61
Tabel 4.8 Hasil Uji Normalitas	62
Tabel 4.9 Hasil Uji Multikolinieritas	63
Tabel 4.10 Hasil Uji Heteroskedastisitas	64
Tabel 4.11 Hasil Uji Autokorelasi	66
Tabel 4.12 Hasil Uji F	66
Tabel 4.13 Hasil Uji T	68
Tabel 4.14 Hasil Uji Determinasi (R^2)	70