

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN NOTA PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN NOTA PENGESAHAN SKRIPSI	iii
HALAMAN SURAT PERNYATAAN.....	iv
ABSTRAK.....	v
HALAMAN MOTTO	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
HALAMAN KATA PENGANTAR	viii
HALAMAN DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv

BAB I : PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan Penelitian.....	9
D. Manfaat Penelitian.....	10
E. Sistematika Penulisan	11

BAB II : LANDASAN TEORI

A. Deskripsi Teori.....	12
1. Analisis Fundamental	12
2. Laporan Keuangan	12
a. Pengertian Laporan Keuangan.....	12
b. Laporan Keuangan	13
c. Pihak-Pihak yang Memerlukan Laporan Keuangan.....	13
3. Teori Rasio Keuangan	16
a. Teori Laporan Keuangan	16
b. Jenis-jenis Rasio Keuangan	17
4. Teori Tingkat Suku Bunga (<i>BI Rate</i>)	21
5. Investasi	21
a. Definisi Investasi	21
b. Jenis dan Bentuk Investasi.....	22
c. Proses Investasi	23
6. Pasar Modal.....	25
a. Pengertian Pasar Modal.....	25
b. Instrumen Pasar Modal	26
c. Pelaku Pasar Modal.....	27
d. Pasar Modal Syariah.....	27
7. Saham.....	30
a. Pengertian Saham	30
b. Jenis Saham	31

c. Nilai Saham	34
d. Harga Saham	35
e. Harga Saham Syariah	36
f. <i>Capital Gain</i> dan <i>Capital Loss</i>	36
g. Agio dan Disagio Saham	36
h. Dividen.....	36
i. Saham Syariah.....	37
j. ISSI (Indeks Saham Syariah Indonesia)	39
B. Penelitian Terdahulu	40
C. Kerangka Berfikir.....	44
D. Hipotesis	47

BAB III : METODE PENELITIAN

A. Jenis dan Pendekatan Penelitian	53
B. Populasi dan Sampel	53
C. Tata Variabel Penelitian	55
D. Definisi Operasional.....	55
E. Teknik Pengumpulan Data	56
F. Teknik Analisis Data	57
1. Estimasi Teknik Penaksiran Model	57
2. Penentuan Metode Estimasi.....	59
3. Uji Asumsi Klasik	60
4. Analisis Regresi Data Panel	62
5. Uji Parsial (Uji t)	62
6. Uji Simultan (Uji F)	62
7. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	63

BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Obyek Penelitian	64
B. Deskripsi Variabel Penelitian	69
1. Deskriptif Harga Saham Syariah	70
2. Deskriptif <i>Earning per Share</i> (EPS)	70
3. Deskriptif <i>Return on Equity</i> (ROE)	71
4. Deskriptif <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	71
5. Deskriptif <i>BI Rate</i>	72
C. Teknik Pemilihan Model	72
D. Uji Asumsi Klasik	74
1. Uji Normalitas.....	74
2. Uji Multikolinearitas	74
3. Uji Heteroskedastisitas.....	75
4. Uji Autokorelasi.....	75
E. Analisis Data	76
1. Model Analisis Regresi Data Panel.....	76
2. Uji Parsial (Uji T)	77

3. Uji Simultan (Uji F)	79
4. Uji Koefisien Determinasi (R^2)	79
F. Pembahasan Hasil Penelitian	80

BAB V : PENUTUP

A. Kesimpulan	87
B. Saran	88

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT PENDIDIKAN



DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Daftar Perusahaan Bergerak pada Sub Sektor Kontruksi Bangunan & Sub Sektor Jalan Tol, Bandara, Pelabuhan dan Sejenisnya yang Terdaftar di ISSI	7
Tabel 2.1	Hasil Penelitian Terdahulu	41
Tabel 3.1	Sampel Penelitian	54
Tabel 4.1	Deskriptif Harga Saham	70
Tabel 4.2	Deskriptif EPS	70
Tabel 4.3	Deskriptif ROE	71
Tabel 4.4	Deskriptif DER	71
Tabel 4.5	Deskriptif <i>BI Rate</i>	72
Tabel 4.6	Uji Chow	73
Tabel 4.7	Uji Hausman	73
Tabel 4.8	Uji Normalitas	74
Tabel 4.9	Uji Uji Multikolinearitas	75
Tabel 4.10	Uji Heteroskedastisitas	75
Tabel 4.11	Uji Autokorelasi	76
Tabel 4.12	Analisis Regresi Data Panel	76
Tabel 4.13	Uji t Parsial	78
Tabel 4.14	Uji F Simultan	79
Tabel 4.15	Uji Koefisien Determinasi R^2	79

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Model Penelitian.....	45
Gambar 4.8 Uji Normalitas	74

