

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	iii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	7
1. Tujuan Penelitian.....	7
2. Kontribusi Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka	9
1. Teori Sinyal	9
2. Laporan Keuangan.....	11
a. Tujuan Laporan Keuangan.....	11
b. Analisis Rasio	12

3. Return Saham.....	13
a. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	15
b. Pasar Modal Syariah	18
c. Jakarta Islamic Index	19
4. Return On Equity	19
5. Total Asset Turnover	20
6. Price Earning Ratio	21
7. Penelitian Terdahulu	23
B. Rerangka Pemikiran	28
1. Hubungan <i>Return On Equity</i> terhadap Return Saham Syariah	28
2. Hubungan <i>Total Asset Turnover</i> terhadap Return Saham Syariah	28
3. Hubungan <i>Price Earning Ratio</i> terhadap Return Saham Syariah	29
C. Hipotesis	30

BAB III METODE PENELITIAN

A. Waktu dan Tempat Penelitian	32
B. Desain Penelitian	32
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	32
1. Variabel Dependen	32
2. Variabel Independen	33

D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	35
E. Teknik Pengumpulan Data	38
F. Jenis Data.....	38
G. Metode Analisis Data	38
1. Analisis Deskriptif	38
2. Uji Asumsi Klasik.....	39
a. Uji Normalitas.....	39
b. Uji Multikolonieritas.....	39
c. Uji Autokorelasi.....	40
d. Uji Heteroskedastisitas.....	41
3. Uji Kesesuaian Model.....	42
a. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	42
b. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	43
4. Uji Hipotesis	43
a. Uji Statistik (t-test).....	43
b. Analisis Regresi Linier Berganda	44

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum	45
B. Statistik Deskriptif.....	45
C. Uji Asumsi Klasik	49
1. Hasil Uji Normalitas	49
2. Hasil Uji Multikolonieritas	50
3. Hasil Uji Autokorelasi.....	51

4. Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	52
D. Uji Kesesuaian Model	54
1. Uji Koefisien Determinasi	54
2. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	55
E. Uji Hipotesis	56
1. Hasil Uji Statistik (t-test).....	56
2. Hasil Uji Regresi Linier Berganda	57
F. Pembahasan Hasil Penelitian	58
1. Pengaruh Return On Equity terhadap Return Saham Syariah	58
2. Pengaruh Total Asset Turnover terhadap Return Saham Syariah	59
3. Pengaruh Price Earning Ratio terhadap Return Saham Syariah	59
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
A. Simpulan.....	61
B. Saran	62
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN	