

DAFTAR ISI

Halaman Sampul Luar	
Halaman Sampul Dalam	ii
Halaman Persetujuan Pembimbing	iii
Halaman Pengesahan Penguji	iv
Halaman Motto	v
Halaman Persembahan	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Isi.....	ix
Daftar Tabel	xii
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Lampiran.....	xiv
Abstrak.....	xv
Abstract	xvi
BAB I : PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Identifikasi Masalah	7
C. Rumusan Masalah	7
D. Tujuan Penelitian	8
E. Manfaat Penelitian.....	8
F. Ruang Lingkup dan Keterbatasan Penelitian.....	9
G. Penegasan Istilah.....	10
H. Sistematika Penulisan Skripsi	13
BAB II : LANDASAN TEORI	
A. <i>Return Saham</i>	15
B. Analisis Rasio Keuangan	16
C. <i>Earning Per Share</i>	18
D. <i>Debt to Equity Ratio</i>	20
E. <i>Return On Equity</i>	21

F. Daftar Efek Syariah (DES)	22
G. Kajian Penelitian Terdahulu.....	23
H. Kerangka Konseptual	36
I. Hipotesis Penelitian	39

BAB III : METODE PENELITIAN

A. Pendekatan dan Jenis Penelitian	40
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian	41
C. Sumber Data, Variabel Penelitian dan Skala Pengukuran.....	43
D. Teknik Pengumpulan Data dan Instrumen Penelitian	44
E. Teknik Analisis Data	45
1. Uji Analisis Regresi Data Panel	46
2. Uji Asumsi Klasik.....	48
3. Uji Hipotesis	50
4. Koefisiensi Determinasi (R^2).....	52

BAB IV : HASIL PENELITIAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian	53
B. Analisis Statistik Deskriptif.....	63
C. Analisis Regresi Data Panel.....	66
1. Estimasi Model Regresi Data Panel.....	66
2. Pemilihan Estimasi Model Regresi Data Panel	67
D. Uji Asumsi Klasik	71
1. Uji Normalitas	71
2. Uji Multikolinearitas	71
3. Uji Heterokedastisitas	72
E. Uji Hipotesis	73
1. Uji Analisis Regresi Data Panel	73
2. Uji t	75
3. Uji F	77
F. Koefisien Determinasi (R^2).....	77

BAB V : PEMBAHASAN

- A. Pengaruh *Earning Per Share* Terhadap *Return Saham* Perusahaan yang Terdaftar dalam Daftar Efek Syariah 79
- B. Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return Saham* Perusahaan yang Terdaftar dalam Daftar Efek Syariah 81
- C. Pengaruh *Return On Equity* Terhadap *Return Saham* Perusahaan yang Terdaftar dalam Daftar Efek Syariah 83
- D. Pengaruh *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return On Equity* Terhadap *Return Saham* Perusahaan yang Terdaftar dalam Daftar Efek Syariah 85

BAB VI : PENUTUP

- A. Kesimpulan 87
- B. Saran 88

DAFTAR PUSTAKA 90

LAMPIRAN – LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Daftar Sampel Penelitian	42
Tabel 4.1 Hasil Uji Analisis Statistik Deskriptif	64
Tabel 4.2 Hasil Uji Regresi <i>Common Effect Model</i>	66
Tabel 4.3 Hasil Uji Regresi <i>Fixed Effect Model</i>	66
Tabel 4.4 Hasil Uji Regresi <i>Random Effect Model</i>	67
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Chow</i>	68
Tabel 4.6 Hasil Uji Hausman	69
Tabel 4.7 Hasil Uji <i>Langrange Multiplier</i>	70
Tabel 4.8 Hasil Uji Multikolinieritas	72
Tabel 4.9 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	73
Tabel 4.10 Hasil Uji dengan Menggunakan <i>Common Effect Model</i>	74
Tabel 4.11 Hasil Regresi Uji t	76
Tabel 4.12 Hasil Regresi Uji F	77
Tabel 4.13 Hasil Regresi Uji Koefisien Determinasi.....	78

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Diagram <i>Return</i> Saham.....	6
Gambar 2.1 Kerangka Konseptual.....	36
Gambar 4.1 Hasil Regresi Uji Normalitas.....	71

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Data Penelitian

Lampiran 2 : Hasil Analisis Data

Lampiran 3 : Kartu Kendali Bimbingan

Lampiran 4 : Pernyataan Keaslian Tulisan

Lampiran 5 : Daftar Riwayat Hidup