

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN SAMPUL DALAM.....</b>	<b>ii</b>
<b>PERSETUJUAN PEMBIMBING .....</b>	<b>iii</b>
<b>PENGESAHAN PENGUJI .....</b>	<b>iv</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>v</b>
<b>PERSEMBAHAN.....</b>	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR GRAFIK .....</b>	<b>xv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xvi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xvii</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>xviii</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>xix</b>

### **BAB I PENDAHULUAN**

<b>A. Latar Belakang Masalah.....</b>	<b>1</b>
<b>B. Rumusan Masalah .....</b>	<b>12</b>
<b>C. Tujuan Penelitian.....</b>	<b>12</b>
<b>D. Kegunaan Penelitian.....</b>	<b>13</b>
<b>E. Ruang Lingkup dan Keterbatasan Penelitian .....</b>	<b>14</b>

F. Penegasan Istilah .....	15
G. Sistematika Penulisan Skripsi .....	18

## **BAB II LANDASAN TEORI**

A. Pasar Modal Syariah .....	20
1. Pengertian Pasar Modal Syariah .....	20
2. Indeks Saham Syariah .....	21
3. <i>Jakarta Islamic Index</i> .....	23
B. <i>Signaling Theory</i> .....	25
C. <i>Return Saham</i> .....	26
D. Rasio Likuiditas .....	28
E. Rasio Profitabilitas .....	29
F. Rasio Solvabilitas .....	30
G. Hubungan Antar Variabel .....	31
H. Kajian Penelitian Terdahulu .....	34
I. Kerangka Konseptual .....	38
J. Hipotesis Penelitian .....	39

## **BAB III METODE PENELITIAN**

A. Pendekatan dan Jenis Penelitian .....	41
1. Pendekatan Penelitian .....	41
2. Jenis Penelitian .....	41
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian .....	42

1. Populasi Penelitian .....	42
2. Teknik Sampling .....	42
3. Sampel Penelitian .....	43
C. Sumber Data, Variabel, dan Skala Pengukuran .....	44
1. Sumber Data .....	44
2. Variabel .....	44
3. Skala Pengukuran .....	45
D. Teknik Pengumpulan Data dan Instrumen Penelitian .....	46
1. Teknik Pengumpulan Data .....	46
2. Instrumen Penelitian .....	47
E. Analisis Data .....	47
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	48
2. Uji Multikolinearitas .....	48
3. Estimasi Model Regresi Data Panel .....	49
4. Estimasi Model Pemilihan .....	50
5. Analisis Regresi Data Panel .....	51
6. Uji Hipotesis .....	52
a. Uji Koefisien Determinasi .....	52
b. Uji F Simultan .....	52
c. Uji T Parsial .....	53
7. Uji Asumsi Klasik .....	54

## **BAB IV HASIL PENELITIAN**

A. Deskripsi Umum Objek Penelitian.....	57
B. Deskripsi Variabel Penelitian.....	69
1. Deskripsi Variabel <i>Return</i> Saham.....	69
2. Deskripsi Variabel Rasio Likuiditas .....	71
3. Deskripsi Variabel Rasio Profitabilitas.....	73
4. Deskripsi Variabel Rasio Solvabilitas.....	75
C. Uji Statistik Deskriptif .....	76
D. Uji Multikolinearitas .....	77
E. Uji Regresi Data Panel .....	78
F. Uji Hipotesis.....	83
1. Uji Koefisien Determinasi.....	83
2. Uji F simultan.....	84
3. Uji T Parsial .....	85
G. Uji Asumsi Klasik .....	86
1. Uji Normalitas .....	86
2. Uji Heteroskedastisitas .....	87
3. Uji Autokorelasi .....	88

## **BAB V PEMBAHASAN**

A. Pengaruh Rasio Likuiditas, Rasio Profitabilitas Dan Rasio Solvabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018-2022.....	90
--	----

B. Pengaruh Rasio Likuiditas Terhadap <i>Return</i> Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018-2022 .....	92
C. Pengaruh Rasio Profitabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018-2022 .....	94
D. Pengaruh Rasio Solvabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018- 2022 .....	96

## **BAB VI PENUTUP**

A. Kesimpulan.....	99
B. Saran.....	100

<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>102</b>
-----------------------------	------------

## **LAMPIRAN**

## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Tabel Kriteria Sampel .....	43
Tabel 3.2 Tabel Sampel Penelitian.....	44
Tabel 3.3 Tabel Skala Pengukuran .....	46
Tabel 4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	77
Tabel 4.2 Hasil Uji Multikolinearitas .....	78
Tabel 4.3 Hasil Uji Chow.....	79
Tabel 4.4 Hasil Uji Hausman .....	80
Tabel 4.5 Hasil Uji Regresi Data Panel .....	81
Tabel 4.6 Hasil Uji Koefisien Detreminasi .....	83
Tabel 4.7 Hasil Uji F Simultan .....	84
Tabel 4.8 Hasil Uji T Parsial.....	85
Tabel 4.9 Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	88
Tabel 4.10 Hasil Uji Autokorelasi .....	89

## DAFTAR GRAFIK

Grafik 1.1 Perkembangan <i>Return</i> Saham Perusahaan Yang Tetap Konsisten Tercantum Dalam JII Tahun 2018-2022 .....	4
Grafik 4.1 <i>Return</i> Saham Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018-2022 .....	70
Grafik 4.2 <i>Current Ratio</i> Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2018-2022 .....	72
Grafik 4.3 <i>Return On Assets</i> Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic</i> <i>Index</i> Periode 2018-2022 .....	74
Grafik 4.4 <i>Debt to Equity Ratio</i> Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic</i> <i>Index</i> Periode 2018-2022 .....	75

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual .....	39
Gambar 4.1 Hasil Uji Normalitas.....	87



## **DAFTAR LAMPIRAN**

- Lampiran 1: Data Variabel Penelitian
- Lampiran 2: Hasil Uji Statistik Deskriptif
- Lampiran 3: Hasil Uji Asumsi Klasik
- Lampiran 4: Hasil Uji Regresi Data Panel
- Lampiran 5: Hasil Uji Koefisien Determinasi
- Lampiran 6: Hasil Uji F Simultan
- Lampiran 7: Hasil Uji T Parsial
- Lampiran 8: Kartu Kendali Bimbingan Skripsi
- Lampiran 9: Surat Pernyataan Keaslian Tulisan
- Lampiran 10: Daftar Riwayat Hidup