

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
<b>JUDUL</b>	
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>i</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>PERNYATAAN ORISINILITAS</b> .....	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Perumusan Masalah.....	9
C. Kegunaan Penelitian.....	10
1. Kegunaan Teoritis.....	10
2. Kegunaan Praktis.....	10
<b>BAB II KAJIAN TEORETIK</b>	
A. Deskripsi Konseptual.....	11
1. Pasar Modal.....	11
2. Investasi.....	12
3. Saham.....	13
4. Saham Syariah dan <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i> .....	14
5. <i>Return Saham</i> .....	16
6. <i>Current Ratio (CR)</i> .....	18
7. <i>Debt To Equity Ratio (DER)</i> .....	20
8. <i>Earning Per Share (EPS)</i> .....	22
9. <i>Price To Book Value (PBV)</i> .....	24
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	24
C. Kerangka Teoretik.....	33
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	37
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN</b>	
A. Tujuan Penelitian.....	38
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	38
C. Metode Penelitian.....	39
D. Populasi dan Sampling.....	40
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	42
1. Variabel dependen atau variabel terikat (Y).....	42
2. Variabel independen atau variabel bebas (X).....	43
F. Teknik Analisa Data.....	45

1. Statistik Deskriptif .....	46
2. Uji Asumsi Klasik.....	46
3. Analisa Model Regresi Data Panel.....	49
4. Pendekatan Model Estimasi Data Panel.....	53
5. Pengujian Hipotesis.....	55
6. Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	58
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b>	
A. Deskripsi Data.....	59
B. Pengujian Hipotesis.....	65
1. Uji Asumsi Klasik.....	65
2. Analisis Regresi Data Panel.....	69
3. Pemilihan Pendekatan Model Estimasi Data Panel.....	70
4. Uji Hipotesis.....	74
C. Pembahasan.....	77
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
A. Kesimpulan.....	83
B. Saran.....	84
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>85</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>89</b>
<b>RIWAYAT HIDUP.....</b>	<b>101</b>

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul
1	Statistik Deskriptif
2	Hasil Uji Outlier
3	Hasil Uji Heteroskedastisitas
4	Hasil Uji Autokorelasi
5	Hasil Uji Metode <i>Common Effect (Pooled Ordinary Least Square/PLS)</i>
6	Hasil Uji Metode <i>Fixed Effect (Fixed Effect Model/FEM)</i>
7	Hasil Uji Metode <i>Random Effect (Random Effect Model/REM)</i>
8	Hasil Uji Chow ( <i>Chow Test</i> )
9	Hasil Uji Hausman ( <i>Hausman Test</i> )
10	Data Sample Perusahaan Yang Terdaftar Di JII Periode 2010-2013

## DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
I.1	Kapitalisasi Pasar di Bursa Efek Indonesia (Rp) Miliar Tahun 2010-2013.....	3
II.1	<i>Review</i> Penelitian Terdahulu.....	30
III.1	Nama Perusahaan yang Terpilih Menjadi Sampel.....	41
III.2	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	45
IV.1	Statistik Deskriptif.....	59
IV.2	Hasil Uji Multikolinearitas.....	67
IV.3	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	67
IV.4	Hasil Uji Autokorelasi.....	68
IV.5	Hasil Uji Metode <i>Common Effect</i> (PLS).....	69
IV.6	Hasil Uji Metode <i>Fixed Effect</i> (FEM).....	70
IV.7	Hasil Uji Metode <i>Random Effect</i> (REM).....	70
IV.8	Hasil Uji Chow ( <i>Chow Test</i> ).....	71
IV.9	Hasil Uji Hausman ( <i>Hausman Test</i> ).....	72
IV.10	Hasil Uji Regresi Data Panel.....	73

## DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
I.1	Rata-Rata <i>Return</i> Saham Perusahaan Yang Terdaftar Di <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) Tahun 2010-2013.....	4
II.1	Kerangka Pemikiran Teoretik .....	37
IV.1	Hasil Uji Normalitas.....	66
IV.2	Bagan Autokorelasi.....	69