DAFTAR ISI

Halaman

SAMPUL DALAM i

PERNYATAAN KEASLIAN ii

PERSETUJUAN PEMBIMBING iii

PENGESAHAN MUNAQOSAH iv

ABSTRAK v

KATA PENGANTAR vi

DAFRTAR ISI vii

DAFTAR TABEL ix

DAFTAR GAMBAR x

DAFTAR TRANSLITERASI xi

BAB I PENDAHULUAN 1

A. Latar Belakang Masalah 1

B. Rumusan Masalah 12

C. Tujuan dan Kegunaan Hasil Penelitian 12

BAB II KAJIAN PUSTAKA 15

A. Landasan Teori 15

1. Pasar Modal Syariah 15

2. Jakarta Islamic Index(JII) 17

3. Saham 22

4. Penggolongan Rasio 25

5. Tingkat Pengembalian Investasi 27

6. Risiko Investasi 28

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

B. Penelitian Terdahulu..... 28
C. Kerangka Konseptual..... 31
D. Hipotesis..... 32

BAB III METODE PENELITIAN..... 33

A. Jenis Penelitian..... 33
B. Waktu dan Tempat Penelitian..... 33
C. Populasi dan Sampel Penelitian..... 34
D. Variabel Penelitian 36
E. Definisi Operasional..... 37
F. Data dan Sumber Data..... 40
G. Teknik Pengumpulan Data 41
H. Teknik Analisis Data 42

BAB IV HASIL PENELITIAN 45

A. Paparan Hasil Penelitian..... 46
B. Deskripsi Hasil Penelitian..... 46
C. Analisis Data 57

BAB V PEMBAHASAN..... 69

BAB VI PENUTUP 83

A. Kesimpulan..... 83
B. Saran..... 84

DAFTAR PUSTAKA 87

LAMPIRAN..... 88

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

DAFTAR TABEL

1.1: Saham Syariah yang Tercatat di BEI tahun 2007-2014..... 5

2.1: Penelitian Terdahulu 30

3.1: Daftar Perusahaan Kelompok JII Tahun 2014.... 34

3.2: Daftar Nama Perusahaan Kelompok JII yang Memenuhi Kriteriayang Digunakan Sebagai Sampel 36

4.1: Daftar Harga Saham Perusahaan Sampel Kelompok JII tahun 2012-2014 48

4.2: Daftar EPS Saham Perusahaan Sampel Kelompok JII tahun 2012-2014..... 51

4.3: Daftar ROE Saham Perusahaan Sampel Kelompok JII tahun 2012-2014..... 53

4.4: Daftar DER Saham Perusahaan Sampel Kelompok JII tahun 2012-2014..... 55

4.5: Hasil Uji Normalitas 59

4.6: Hasil Uji *Multikolinearitas* 60

4.7: Hasil Uji Autokorelasi 62

4.8: Hasil Regresi Linier Berganda..... 63

4.9: Hasil Uji f..... 65

4.1: Hasil Uji t..... 66

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

DAFTAR GAMBAR

2.1: Konsep Dasar Pasar Modal Syariah..... 17

2.2: Kerangka Konseptual..... 31

4.1: Kurva Lonceng..... 58

4.2: Uji Heteroskedastisitas..... 61

5.1: Grafik Harga Saham HRUM Tahun 2013..... 75

5.2: Grafik Harga Saham SMGR Tahun 2013..... 77

5.3: Grafik Harga Saham BSDE Tahun 2014..... 80

5.4: Grafik Harga Saham AALI Tahun 2013..... 82

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id

DAFTAR TRANSLITERASI

Di dalam naskah skripsi ini banyak dijumpai nama dan istilah teknis (technical term) yang berasal dari bahasa Arab ditulis dengan huruf latin. Pedoman transliterasi yang digunakan untuk penulisan tersebut adalah sebagai berikut:

1. Fonem konsonan Arab, yang dalam sistem tulisan Arab seluruhnya dilambangkan dengan huruf, dan transliterasinya ke tulisan Latin sebagian dilambangkan dengan lambing huruf, sebagian dengan tanda, dan sebagian lainnya dengan huruf dan tanda sekaligus sebagai berikut:

ARAB		**LATIN**	
Kons	Nama	Kons	Nama
ا	Alif	‘	Tidak dilambangkan
ب	Ba	B	Be
ت	Ta	T	Te
ث	Sa	s|	Es (dengan titik di atas)
ج	Jim	J	Je
ح	Ha	h{	Ha (dengan titik di bawah)
خ	Kha	kh	Ka dan Ha
د	Dal	D	De
ذ	Zal	z|	Zet (dengan titik di atas)
ر	Ra	R	Er
ز	Zai	Z	Zet
س	Sin	S	Es
ش	Syin	Sy	Es dan Ye
ص	Sad	s{	Es (dengan titih di bawah)

digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id digilib.uinsby.ac.id