

## DAFTAR ISI

|  |            |
|--|------------|
| <b>ABSTRAK .....</b>   | <b>i</b>   |
| <b>KATA PENGANTAR.....</b>   | <b>ii</b>  |
| <b>DAFTAR ISI.....</b>   | <b>vii</b> |
| <b>DAFTAR TABEL .....</b>  | <b>x</b>   |
| <b>DAFTAR GAMBAR.....</b>  | <b>xi</b>  |
| <b>BAB I : PENDAHULUAN.....</b>  | <b>1</b>   |
| 1.1 Latar Belakang Masalah.....  | 1          |
| 1.2 Rumusan Masalah .....  | 10         |
| 1.3 Tujuan Penelitian .....  | 10         |
| 1.4 Manfaat Penelitian .....   | 11         |
| 1.5 Sistematika Penulisan .....  | 12         |
| <b>BAB II : TELAAH PUSTAKA .....</b>   | <b>14</b>  |
| 2.1 <i>Return</i> Saham .....  | 14         |
| 2.2 Volume Perdagangan .....   | 18         |
| 2.3 Nilai Tukar .....  | 20         |
| 2.4 Konsep Islam yang Berhubungan dengan Penelitian .....                        | 24         |
| 2.5 Penelitian Terdahulu .....   | 27         |
| 2.6 Kerangka Pemikiran.....  | 33         |
| 2.7 Hipotesis.....   | 33         |
| 2.7.1 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap <i>Retun</i> Saham... 33              |            |
| 2.7.2 Pengaruh Nilai Tukar Terhdap Return Saham .....                            | 34         |
| 2.7.3 Pengaruh Volume Perdagangan dan Nilai Tukar Terhadap<br>Return Saham ..... | 35         |
| <b>BAB III : METODE PENELITIAN.....</b>  | <b>36</b>  |
| 3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian .....  | 36         |
| 3.2 Jenis dan Sumber Data .....  | 36         |
| 3.3 Populasi dan Sampel .....  | 38         |
| 3.4 Metode Pengumpulan Data .....  | 39         |
| 3.5 Definisi Operasional Variabel Penelitian.....                                | 40         |
| 3.6 Metode Analisis Data.....  | 42         |
| 3.6.1 Uji Stationer .....  | 43         |
| 3.6.1.1 Uji Akar Unit.....   | 44         |
| 3.6.2 Uji Asumsi Klasik .....  | 45         |
| 3.6.2.1 Uji Normalitas .....   | 45         |
| 3.6.2.2 Uji Multikolinieritas.....   | 46         |
| 3.6.2.3 Uji Heteroskedastisitas .....  | 47         |
| 3.6.2.4 Uji Autokorelasi .....   | 48         |

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
  - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
  - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

|  |    |
|--|----|
| 3.6.3 Analisis Regresi dengan Data Panel .....   | 48 |
| 3.6.4 Pemilihan Model .....                      | 51 |
| 3.6.5 Pengujian Hipotesis.....                   | 52 |
| 3.6.5.1 Uji Parsial (Uji-t).....                 | 53 |
| 3.6.5.2 Uji Simultan (Uji-F).....                | 53 |
| 3.6.5.3 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ )..... | 54 |

**BAB IV : GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN..... 56**

|  |    |
|--|----|
| 4.1 Gambaran Umum Sampel Penelitian .....        | 56 |
| 4.1.1 PT Astra Internasional Tbk .....           | 56 |
| 4.1.2 PT Astra Otoparts Tbk .....                | 56 |
| 4.1.3 PT Gajah Tunggal Tbk.....                  | 57 |
| 4.1.4 PT Indomobil Sukses Internasional Tbk..... | 58 |
| 4.1.5 PT Indospring Tbk .....                    | 59 |
| 4.1.6 PT Multi Prima Sejahtera Tbk .....         | 60 |
| 4.1.7 PT Multistrada Arah Sarana Tbk .....       | 61 |
| 4.1.8 PT Nipress Tbk.....                        | 62 |
| 4.1.9 PT Prima Alloy Steel Universal Tbk .....   | 62 |
| 4.1.10 PT Selamat Sempurna Tbk.....              | 63 |
| 4.1.11 PT IndoKordsa Tbk.....                    | 64 |
| 4.1.12 PT Goodyear Indonesia Tbk .....           | 65 |

**BAB V : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... 66**

|   |    |
|---|----|
| 5.1 Deskripsi Data Penelitian.....        | 66 |
| 5.2 Analisis Deskriptif.....              | 69 |
| 5.3 Uji Stasioneritas .....               | 71 |
| 5.3.1 Uji Akar Unit.....                  | 71 |
| 5.4 Uji Asumsi Klasik.....                | 73 |
| 5.4.1 Uji Normalitas .....                | 73 |
| 5.4.2 Uji Multikolinieritas.....          | 74 |
| 5.4.3 Uji Heteroskedastisitas.....        | 76 |
| 5.4.4 Uji Autokorelasi .....              | 77 |
| 5.5 Analisis Regresi Data Panel.....      | 78 |
| 5.6 Uji Hipotesis .....                   | 79 |
| 5.6.1 Uji Parsial (Uji-t).....            | 79 |
| 5.6.2 Uji Simultan (Uji-F).....           | 81 |
| 5.6.3 Uji Koefisien Determinasi (R) ..... | 82 |
| 5.7 Pembahasan Hasil Penelitian .....     | 83 |
| 5.7.1 Hasil Pengujian Statistik H1 .....  | 83 |
| 5.7.2 Hasil Pengujian Statistik H2 .....  | 85 |
| 5.7.3 Hasil Pengujian Statistik H3 .....  | 86 |

**Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang**

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
  - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
  - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

|                               |           |
|-------------------------------|-----------|
| <b>BAB VI : PENUTUP .....</b> | <b>88</b> |
| 6.1 Kesimpulan .....          | 88        |
| 6.2 Saran.....                | 89        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>   | <b>90</b> |
| <b>LAMPIRAN</b>               |           |

