

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	8
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
1.5 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	11
2.2 Laporan Keuangan.....	12
2.3 Saham.....	14
2.3.1 Pengertian Saham.....	14
2.3.2 Jenis-jenis Saham.....	15
2.3.3 Harga Saham.....	16
2.4 <i>Stock Return</i>	17
2.5 Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Stock Return</i>	20
2.6 <i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	23
2.7 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	24
2.8 <i>Return on Equity</i> (ROE).....	25
2.9 <i>Firm Size</i>	25
2.10 Saham dalam Perspektif Islam.....	27
2.11 Penelitian Terdahulu.....	30
2.11.1 Perbedaan dengan Penelitian Terdahulu.....	35

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.

2.12 Kerangka Pemikiran	36
2.13 Konsep Operasional Variabel.....	36
2.14 Hipotesis Penelitian	39

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	44
3.2 Jenis dan Sumber Data	44
3.3 Metode Pengumpulan Data	45
3.4 Variabel Penelitian.....	45
3.5 Populasi dan Sampel	46
3.6 Metode Analisis Data	47
3.6.1 Uji Akar Unit.....	48
3.6.1.1 Uji <i>Augmented Dickey-Fuller</i>	49
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	50
3.6.2.1 Uji Multikolinearitas	51
3.6.2.2 Uji Heteroskedastisitas	51
3.6.2.3 Uji Autokorelasi.....	52
3.6.3 Analisis Regresi dengan Data Panel.....	54
3.6.4 Pemilihan Model.....	58
3.6.5 Analisis Regresi.....	60
3.6.6 Pengujian Hipotesis	60
3.6.6.1 Uji Parsial (Uji-t).....	60
3.6.6.2 Uji Simultan (Uji F)	61
3.6.6.3 Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	62

BAB IV GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN

4.1 Astra Agro Lestari Tbk	63
4.2 Adaro Energy Tbk.....	64
4.3 AKR Corporindo Tbk	65
4.4 Astra International Tbk	66
4.5 Bumi Serpong Damai Tbk.....	68
4.6 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk	69

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.

4.7 Indofood Sukses Makmur Tbk	70
4.8 Kalbe Farma Tbk	71
4.9 Lippo Karawaci Tbk	72
4.10 PP London Sumatra Indonesia Tbk	73
4.11 Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk	75
4.12 Semen Indonesia (Persero) Tbk.....	76
4.13 Summarecon Agung Tbk	77
4.14 Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk	79
4.15 United Tractors Tbk.....	81
4.16 Unilever Indonesia Tbk.....	82
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	
5.1 Deskripsi Objek Penelitian	84
5.2 Analisa Data	84
5.2.1 Analisa Data Penelitian.....	84
5.2.1.1 Statistik Deskriptif.....	85
5.2.2 Uji Stasioneritas.....	87
5.2.2.1 Uji Akar Unit	87
5.2.3 Uji Asumsi Klasik.....	88
5.2.3.1 Uji Multikolinearitas	89
5.2.3.2 Uji Heteroskedastisitas	90
5.2.3.3 Uji Autokorelasi	91
5.2.4 Analisis Regresi Data Panel	91
5.2.4.1 Uji <i>Chow</i>	92
5.2.4.2 Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	93
5.2.5 Uji Parsial (Uji t)	96
5.2.6 Uji Simultan (Uji F).....	98
5.2.7 Koefisien Determinasi (R^2)	99
5.2.8 Interpretasi Hasil.....	100
BAB VI PENUTUP	
6.1 Kesimpulan.....	105

6.2 Saran.....	107
----------------	-----

DAFTAR PUSTAKA.....	109
----------------------------	------------

LAMPIRAN



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.

