

DAFTAR ISI

COVER DALAM	Kesalahan! Bookmark tidak ditentukan.
HALAMAN PENGESAHAN	Kesalahan! Bookmark tidak ditentukan.
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	Kesalahan! Bookmark tidak ditentukan.
ABSTRAK.....	vi
ABSTRACT.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang.....	1
1.3 Perumusan Masalah.....	7
1.4 Pertanyaan Penelitian.....	8
1.5 Tujuan Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	9
1.8 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
2.1 Teori-teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu.....	11
2.1.1 Tinjauan Pustaka.....	11
2.1.1.1 Investasi.....	11
2.1.1.2 Pasar Modal.....	12
2.1.1.3 Pasar Modal Syariah.....	13
2.1.1.4 Saham	13
2.1.1.5 Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI).....	15

2.1.1.6 <i>Return</i>	16
2.1.1.7 Likuiditas (<i>Bid-Ask Spread</i>).....	17
2.1.1.8 <i>Return On Assets</i> (ROA).....	18
2.1.1.9 <i>Return On Equity</i> (ROE).....	18
2.1.2 Penelitian Terdahulu.....	19
2.2 Kerangka Pemikiran.....	29
2.2.1 <i>Return On Assets</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i>	29
2.2.2 <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>Return Saham</i>	30
2.2.3 <i>Bid Ask Spread</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i>	30
2.3 Hipotesis Penelitian.....	32
BAB III METODE PENELITIAN	33
3.1 Karakteristik Penelitian.....	33
3.2 Variabel Operasional.....	33
3.3 Alat Pengumpulan Data.....	35
3.4 Tahapan Penelitian.....	35
3.5 Populasi dan Sampel.....	37
3.6 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	39
3.7 Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	39
3.7.1 Analisis Deskriptif.....	40
3.7.2 Analisis Data Panel.....	40
3.7.2.1 Model Regresi Data Panel.....	40
3.7.2.2 Pemilihan Model Estimasi Data Panel.....	43
3.7.2.3 Pengujian Signifikansi.....	44
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	47
4.1 Objek Penelitian.....	47
4.2 Analisis Deskriptif.....	47
4.2.1 Analisis Deskriptif Variabel <i>Return On Assets</i> (ROA).....	47
4.2.2 Analisis Deskriptif Variabel <i>Return On Equity</i> (ROE).....	49
4.2.2 Analisis Deskriptif Variabel <i>Bid Ask Spread</i>	51
4.2.3 Analisis Deskriptif Variabel <i>Return</i>	52
4.3 Analisis Regresi Data Panel.....	54

4.3.1 Pemilihan Metode Estimasi Regresi Data Panel.....	54
4.3.2 Persamaan Regresi Data Panel.....	56
4.4 Uji Hipotesis.....	58
4.4.1 Uji Simultan.....	58
4.4.2 Uji Parsial.....	58
4.5 Hasil Penelitian dan Pembahasan.....	59
4.5.1 Pengaruh <i>Return On Assets</i> (ROA) terhadap <i>Return</i> Secara Parsial.....	59
4.5.1 Pengaruh <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>Return</i> Secara Parsial.....	59
4.5.2 Pengaruh <i>Bid Ask Spread</i> terhadap <i>Return</i> Secara Parsial.....	59
4.5.3 Pengaruh ROA, ROE, dan <i>Bid Ask Spread</i> terhadap <i>Return</i>	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	61
5.1 Kesimpulan.....	61
5.2 Saran.....	61
DAFTAR PUSTAKA.....	63
LAMPIRAN.....	69

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar Jumlah Saham Syariah yang Tercatat di BEI.....	1
Tabel 1.2 <i>Return</i> Saham ISSI.....	5
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	22
Tabel 2.2 Kerangka Pemikiran.....	30
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian.....	33
Tabel 3.2 Variabel Operasional.....	34
Tabel 3.3 Proses Pemilihan Sampel.....	36
Tabel 3.4 Daftar Sampel.....	36
Tabel 4.1 Hasil Analisis Deskriptif Variabel Profitabilitas ROA.....	48
Tabel 4.2 Hasil Analisis Deskriptif Variabel Profitabilitas ROE.....	49
Tabel 4.3 Hasil Analisis Deskriptif Variabel Likuiditas (<i>Bid Ask Spread</i>).....	51
Tabel 4.4 Hasil Analisis Deskriptif Variabel <i>Return</i>	53
Tabel 4.5 Uji Wald.....	55
Tabel 4.6 Uji Hausman.....	55
Tabel 4.7 Uji <i>Fixed Effect</i>	57

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Perkembangan Saham Syariah Indonesia	3
Gambar 1.2 Pergerakan ISSI <i>Year-to-Date</i> (YTD)	4
Gambar 3.1 Tahapan Penelitian.....	37

