

## DAFTAR ISI

Isi	Halaman
HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERNYATAAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN .....	iii
HALAMAN PENGESAHAN .....	iv
RIWAYAT HIDUP .....	v
PERSEMBAHAN .....	vi
MOTTO .....	vii
ABSTRAK .....	viii
ABSTRACT .....	ix
KATA PENGANTAR .....	x
DAFTAR ISI .....	xii
DAFTAR TABEL .....	xvi
DAFTAR GAMBAR .....	xvii

### BAB I: PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Ruang Lingkup Penelitian .....	8
1.3 Rumusan Masalah.....	9
1.4 Tujuan Penelitian .....	9
1.5 Manfaat Penelitian .....	10
1.6 Sistematika Penulisan .....	11

### BAB II: LANDASAN TEORI

2.1 Teori Sinyal .....	13
2.2 Pasar Modal Syariah .....	14
2.3 Saham Syariah .....	14
2.4 Risiko Investasi.....	14
2.5 Beta Saham .....	14
2.6 <i>Current Ratio</i> .....	15

2.7	<i>Return On Asset</i> .....	16
2.8	<i>Return On Equity</i> .....	16
2.9	<i>Total Asset Turn Over</i> .....	17
2.10	<i>Debt To Equity Ratio</i> .....	17
2.11	<i>Asset Growth</i> .....	17
2.12	<i>Leverage</i> .....	18
2.13	Penelitian Terdahulu .....	19
2.14	Kerangka Pemikiran .....	22
2.15	Bangunan Hipotesis .....	22
2.15.1	Pengaruh <i>Current Ratio</i> Terhadap Beta Saham .....	22
2.15.2	Pengaruh <i>Return On Asset</i> Terhadap Beta Saham .....	23
2.15.3	Pengaruh <i>Return On Equity</i> Terhadap Beta Saham .....	23
2.15.5	Pengaruh <i>Total Asset Turn Over</i> Terhadap Beta Saham....	24
2.15.5	Pengaruh <i>Debt To Equity Ratio</i> Terhadap Beta Saham .....	24
2.15.6	Pengaruh <i>Asset Growth</i> Terhadap Beta Saham .....	25
2.15.7	Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap Beta Saham .....	25

### **BAB III: METODE PENELITIAN**

3.1	Sumber Data .....	27
3.2	Metode Pengumpulan Data .....	27
3.3	Populasi dan Sampel .....	28
3.3.1	Populasi .....	28
3.3.2	Sampel .....	28
3.4	Variabel Penelitian Dan Definisi Operasional Variabel .....	29
3.4.1	Variabel Penelitian .....	29
3.4.2	Definisi Operasional Variabel .....	29
3.4.2.1	Variabel Dependen .....	29
3.4.2.2	Variabel Independen .....	30
3.5	Metode Analisis Data .....	33
3.5.1	Statistik Deskriptif .....	33
3.5.2	Penentuan Mode Estimasi Regresi Berganda .....	33
3.5.2.1	Uji Normalitas .....	33
3.5.2.2	Uji Multikoloniaritas .....	34

3.5.2.3 Uji Autokorelasi .....	35
3.5.2.4 Uji Heterokedastisitas .....	35
3.5.3 Analisis Regresi Linier Berganda .....	36
3.6 Pengujian Hipotesis.....	37
3.6.1 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	37
3.6.2 Uji Kelayakan Model (Uji F).....	37
3.6.3 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji Statisti t).....	38

#### **BAB IV: HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1 Deskripsi Data .....	39
4.1.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	39
4.2 Hasil Analisis Data.....	40
4.2.1 Deskriptif.....	40
4.2.2 Uji Asumsi Klasik .....	42
4.2.2.1 Uji Normalitas .....	42
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas .....	43
4.2.2.3 Uji Autokorelasi .....	46
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas .....	47
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis.....	48
4.3.1 Analisis Regresi Linier Berganda.....	48
4.3.1.1 Uji Koefisien Determinasi .....	50
4.3.1.2 Uji Signifikan Simultan (Uji F) .....	50
4.3.1.3 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji T).....	51
4.4 Pembahasan.....	53
4.4.1 Pengaruh <i>Current Ratio</i> Terhadap Beta Saham.....	53
4.4.2 Pengaruh <i>Return On Asset</i> Terhadap Beta Saham.....	54
4.4.3 Pengaruh <i>Return On Equity</i> Terhadap Beta Saham .....	55
4.4.4 Pengaruh <i>Total Asset Turn Over</i> Terhadap Beta Saham.....	55
4.4.5 Pengaruh <i>Debt To Equity Ratio</i> Terhadap Beta Saham .....	56
4.4.6 Pengaruh <i>Asset Growth</i> Terhadap Beta Saham.....	57
4.4.7 Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap Beta Saham .....	57

**BAB V: SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan .....	59
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	59
5.3 Saran.....	60

**DAFTAR PUSTAKA**

**LAMPIRAN**