

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah	1
B. Perumusan Masalah	3
C. Pembatasan Masalah	4
D. Tujuan Penelitian	4
E. Manfaat Penelitian	5
F. Sistematika Pembahasan	5

BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PERUMUSAN HIPOTESIS

A. <i>Return</i> dan Resiko Investasi	7
B. Variabel-variabel yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	11
C. Hubungan Variabel Fundamental dengan <i>Return</i> Saham	14
D. Tinjauan Penelitian Terdahulu	15
E. Perumusan Hipotesis	19

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Populasi dan Penentuan Sampel	20
B. Data dan Sumber yang Digunakan	21
C. Identifikasi dan Pengukuran Variabel	21
1. Variabel Independen	21
2. Variabel Dependen	23
D. Metode Analisis Data	24
E. Pengujian Kenormalan Distribusi Data dan Asumsi Klasik	25
1. Uji Normalitas	25
2. Uji Multikolinearitas	26
3. Uji Autokorelasi	27
4. Uji Heteroskedastisitas	28
F. Pengujian Hipotesis	29

BAB IV ANALISIS DATA

A. Hasil Pengujian Kenormalan Distribusi Data	32
1. Uji Lilliefors (Kolmogorov-Smirnov) dan Shapiro-Wilk	32
2. <i>Normal Probability Plot</i>	33
B. Hasil Pengujian Asumsi Klasik	36
1. Uji Multikolinearitas	36
2. Uji Autokorelasi	38
3. Uji Heteroskedastisitas	39
C. Hasil Pengujian Hipotesis	40
1. Uji Signifikansi Parameter Individual / Uji Statistik t	40
2. Uji Signifikansi Simultan / Uji Statistik F	42
3. Analisis Koefisien Determinasi (R^2)	44
D. Analisis Persamaan Regresi dan Korelasi	45
1. Analisis Hubungan Rasio <i>Sales-Price</i> dengan <i>Return Saham</i>	47
2. Analisis Hubungan Rasio <i>Debt-to-Equity</i> dengan <i>Return Saham</i> ..	48

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan	49
B. Keterbatasan dan Saran	51

DAFTAR PUSTAKA	52
----------------------	----

LAMPIRAN	55
----------------	----

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. <i>Normal Probability Plot</i> dari Rasio <i>Sales-Price</i>	33
Gambar 2. <i>Normal Probability Plot</i> dari Rasio <i>Price-Earnings</i>	34
Gambar 3. <i>Normal Probability Plot</i> dari Rasio <i>Debt-to-Equity</i>	34
Gambar 4. <i>Normal Probability Plot</i> dari Rasio <i>Book-to-Market Value</i>	35
Gambar 5. <i>Normal Probability Plot</i> dari <i>Return Saham</i>	35

DAFTAR TABEL

Tabel 1. Pemilihan Sampel	31
Tabel 2. Pengujian Normalitas	32
Tabel 3. Statistik Kolinearitas	36
Tabel 4. Hasil Analisis Kolinearitas	37
Tabel 5. Hasil Uji Statistik Durbin-Watson	38
Tabel 6. Hasil Uji Heteroskedastisitas	39
Tabel 7. Hasil Uji Statistik t	41
Tabel 8. Hasil Uji Statistik F	43
Tabel 9. Hasil Analisis Koefisien Determinasi (R^2)	44
Tabel 10. Hasil Uji Statistik t (metode <i>backward</i>)	45
Tabel 11. Hasil Analisis Korelasi	46

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Daftar Perusahaan dan Rasio Keuangan	56
Lampiran 2. Data Rata-rata <i>Return</i> Saham	60
Lampiran 3. Hasil Regresi Berganda	61