

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xii
ABSTRACT	xiii
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	8
1.5 Batasan Masalah	8
1.6 Sistematika Penelitian	8
II. LANDASAN TEORI	10

A. Pengertian Dasar	
2.1 Earnings Per Share (EPS)	10
2.1.1 Pengertian EPS	10
2.1.2 Kegunaan EPS	11
2.1.3 Rumus EPS	12
2.2 Risiko Sistematis	13
2.2.1 Beta	14
2.2.1.1 Historical Beta Market	14
2.2.1.2 Beta Akuntansi	15
2.2.1.3 Beta Fundamental	15
2.3 Return	16
B. Tinjauan Penelitian terdahulu	
2.4 Tinjauan Penelitian Terdahulu	18
C. Hipotesis Penelitian	
2.5 Hipotesis Penelitian	22

2.5.1 Pengaruh EPS terhadap <i>Return</i> saham	22
2.5.2 Pengaruh beta terhadap <i>Return</i> saham	26
III. METODE PENELITIAN	27
3.1 Objek Penelitian	27
3.2 Metode Penelitian	27
3.3 Metode Pengumpulan Data	28
3.4 Variabel	28
3.4.1 Variabel Dependen	28
3.4.2 Variabel Independen	29
3.4.2.1 <i>Earnings Per Share</i>	29
3.4.2.2 Risiko Sistematis (beta)	30
3.5 Teknik Pengujian Hipotesis	31
3.5.1 Persamaan Regresi Berganda	31
3.5.2 Uji F atau uji simultan	32
3.5.3 Uji t atau uji Parsial	33
3.5.4 Korelasi Ganda	33
3.5.5 Koefisien Determinasi	34
3.5.6 Uji Multikolinearitas	34
3.5.7 Uji Normalitas	35

IV. HASIL PENELITIAN	36
4.1 Hasil Penelitian	36
4.1.1 Gambaran Obyek Penelitian	36
4.1.2 Analisis Deskriptif Variabel Penelitian	38
4.1.2.1 Analisis Deskriptif Tentang EPS	38
4.1.2.2 Analisis Deskriptif Tentang beta saham	41
4.1.2.3 Analisis Deskriptif Tentang <i>return</i> saham	43
4.1.3 Analisis Regresi	46
4.1.3.1 Pembuktian Hipotesis	48
4.1.3.2 Korelasi Ganda (R)	50
4.1.3.2 Koefisien Determinasi (R^2)	50
4.1.3.3 Uji Multikolinearitas	51
4.1.3.4 Uji Normalitas Data	52
4.2 Pembahasan	53
V. KESIMPULAN DAN SARAN	57
5.1 Kesimpulan	57
5.2 Batasan Penelitian	58
5.3 Saran	59
DAFTAR PUSTAKA	60
LAMPIRAN	63