

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
ABSTRAK.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah.....	6
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Lingkup Penelitian	9
1.7. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI.....	11
2.1 Pasar Modal	11
2.2 Saham.....	13
2.3 Indeks Harga Saham Gabungan.....	15
2.4 Indeks LQ 45.....	16

2.5	Kepemilikan Asing (<i>Foreign Ownership</i>)	17
2.6	Volume Perdagangan Saham	18
2.7	Volume Perdagangan Asing	20
2.8	Analisa Fundamental	22
2.9	Rasio Profitabilitas	24
2.10	Risiko Sistemik	26
2.11	Kajian Penelitian Terdahulu	27
2.12	Perumusan Hipotesis.....	29
2.12.1.	<i>Return On Asset (ROA)</i>	29
2.12.2.	<i>Return On Equity (ROE)</i>	30
2.12.3.	Beta	30
2.13	Kerangka Penelitian	31
BAB III METODE PENELITIAN.....		33
3.1.	Desain Penelitian	33
3.2.	Metode Pengumpulan Data.....	33
3.3.	Metode Pengumpulan Sampel	34
3.4.	Instrumen Penelitian	36
3.5.	Metode Analisis Data.....	37
3.5.1.	Metode Pengelolaan Data	39
3.5.1.1.	Uji Normalitas.....	39
3.5.1.2.	Uji Multikolinearitas.....	40
3.5.1.3.	Uji Heteroskedastisitas	40
3.5.1.4.	Uji Autokorelasi.....	41

3.5.1.5. Analisis Regresi Linear Berganda.....	42
3.5.1.6. Analisis Determinasi (<i>Adjusted R2</i>).....	42
3.5.1.7 Uji Koefisien Regresi secara Bersama – Sama (Uji F).....	43
3.5.1.8. Uji Koefisien Regresi secara Parsial (Uji t).....	43
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	45
4.1. Deskripsi Data.....	45
4.2. Pembahasan.....	45
4.2.1. Analisis Statistik Deskriptif.....	45
4.2.2. Analisis Data	47
4.2.3. Uji Hipotesis	52
4.2.4. Diskusi Hasil Penelitian	55
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	60
5.1. Kesimpulan	60
5.2. Implikasi	62
5.3. Keterbatasan.....	62
5.4. Saran	63
DAFTAR PUSTAKA.....	64

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Tahapan Pemilihan Sampel 2013 – 2017	34
Tabel 3.2 Distribusi Sampel Terpilih Tahun 2013 – 2017.....	35
Tabel 4.1. Hasil Analisis Statistik Deskriptif	46
Tabel 4.2. Hasil Uji Statistik Kolmogrov-Smirnov (K-S)	49
Tabel 4.3. Hasil Uji Multikolinearitas.....	49
Tabel 4.4. Hasil Uji Heteroskedastisitas	51
Tabel 4.5. Hasil Uji Autokorelasi	51
Tabel 4.6. Hasil Uji Regresi Linear Berganda	53
Tabel 4.7. Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis	56

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Perkembangan Jumlah Investor di Pasar Modal Indonesia.....	2
Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	32
Gambar 4.1. Hasil Uji Normalitas	48
Gambar 4.2. Hasil Uji heteroskedasitas	50

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Perusahaan Sampel dan Variabel.....	66
Lampiran 2 Hasil Olah Data SPSS	70