

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Pertanyaan Penelitian	3
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	4
1.6 Sistematika Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....	6
2.1 Landasan Teori.....	6
2.1.1 Pasar Modal	6
2.1.2 Saham.....	6
2.1.3 Indeks Saham.....	7
2.1.4 Return	8
2.1.5 PE Ratio	8
2.1.6 Shiller Ratio	9
2.2 Penelitian Terdahulu.....	9
2.3 Hipotesis.....	12
BAB III METODE PENELITIAN	14

3.1	Desain Penelitian	14
3.2	Definisi Operasional Variabel	14
3.3	Sampel	15
3.4	Teknik Pengumpulan Data	15
3.5	Teknik Analisis Data	16
3.5.1	Model Penelitian	16
3.5.2	Uji Asumsi Klasik	17
3.5.3	Penentuan Model Regresi Data Panel	18
3.5.4	Metode Pengujian Hipotesis	20
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		22
4.1	Statistika Deskriptif	22
4.2	Penentuan Model Regresi Data Panel	24
4.2.1	Uji Chow	26
4.2.2	Uji Hausman	27
4.2.3	Uji Lagrange-Multiplier (LM)	27
4.2.4	Penentuan Model Regresi	28
4.3	Pengujian Asumsi Klasik	28
4.3.1	Normalitas	28
4.3.2	Multikolinearitas	29
4.3.3	Autokorelasi	29
4.3.4	Heteroskedastisitas	30
4.4	Pengujian Hipotesis	31
4.4.1	Hipotesis 1	31
4.4.2	Hipotesis 2	33
4.4.3	Hipotesis 3	34
4.5	Pembahasan	35
BAB V SIMPULAN		37
5.1	Kesimpulan	37
5.2	Keterbatasan Penelitian	38
5.3	Saran	39
Daftar Pustaka		40
Lampiran		42

Daftar Tabel

Tabel 1: Variabel-variabel dalam Penelitian.....	15
Tabel 2: Tabel statistika deskriptif variabel-variabel penelitian.	23
Tabel 3: Regresi Model 1	24
Tabel 4: Regresi Model 2	25
Tabel 5: Regresi Model 3	25
Tabel 6: Regresi Model 4	25
Tabel 7: Hasil Uji Chow	26
Tabel 8: Hasil Uji Hausman	27
Tabel 9: Hasil Uji Lagrange-Multiplier	28
Tabel 10: Model regresi terbaik setiap model	28
Tabel 11: Hasil uji normalitas	29
Tabel 12: Hasil Uji Autokorelasi	30
Tabel 13: Hasil uji heteroskedastisitas	30
Tabel 14: Hasil regresi model 1	32
Tabel 15: Hasil regresi model 3	32
Tabel 16: hasil regresi model 2	33
Tabel 17: Hasil regresi model 4	33
Tabel 18: R^2 variabel independen terhadap variabel dependen RET5.....	34
Tabel 19: R^2 variabel independen terhadap variabel dependen RET1.....	34
Tabel 20: Rangkuman hasil penelitian	35

DAFTAR LAMPIRAN

1. Sampel Perusahaan Kompas100
2. Data Penelitian
3. Output Model Regresi Semua Model
4. Output Uji Memilih Model Regresi
5. Output Model Regresi