

HALAMAN JUDUL

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
ABSTRAK	xi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penulisan	5
1.4 Manfaat Penulisan	5
BAB II.....	7
TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Landasan Teori.....	7
2.1.1 Arbitrage Pricing Theory (APT).....	8
2.1.2 <i>Return Saham</i>	9
2.1.3 Return On Asset (ROA)	12
2.1.4 Earning Per Share (EPS).....	13
2.1.5 Net Profit Margin (NPM).....	14
2.1.6 Debt to Equity Ratio (DER).....	15
2.1.7 Price to Book Value (PBV).....	16
2.2 Penelitian Terdahulu.....	17
2.3 Mekanisme hubungan faktor fundamental dengan <i>return saham</i>	23
2.3.1 Pengaruh <i>Return On Asset (ROA)</i> terhadap <i>Return Saham</i>	23

2.3.2 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap <i>Return Saham</i>	24
2.3.3 Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> (NPM) terhadap <i>Return Saham</i>	25
2.3.4 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	26
2.3.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> (PBV) terhadap <i>Return Saham</i>	27
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis	28
2.5 Perumusan Hipotesis	29
BAB III	30
METODE PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	30
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	30
3.2 Populasi dan Sampel.....	30
3.3 Metode Pengumpulan Data	32
3.4 Definisi Operasional Variabel	32
3.4.1 <i>Return On Asset</i> (ROA).....	33
3.4.2 <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	33
3.4.3 <i>Net Profit Margin</i> (NPM).....	33
3.4.4 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	34
3.4.5 <i>Price to Book Value</i> (PBV).....	34
3.4.6 <i>Return Saham</i>	34
3.6 Teknik Analisis Data	40
3.6.1 Pengujian Asumsi Klasik	40
3.6.1.1 Uji Normalitas	41
3.6.1.2 Uji Multikolinieritas.....	42
3.6.1.3 Uji Heteroskedastisitas	43
3.6.1.4 Uji Autokorelasi.....	45
3.6.2 Analisis Regresi Berganda	47
3.6.3 Pengujian Hipotesis	49
3.6.3.1 Uji Statistik t.....	50
3.6.3.2 Uji Statistik F.....	54
3.6.3.3 Koefisien Determinasi.....	56
BAB IV	58

PENUTUP	58
4.1 Kesimpulan	58
4.2 Saran.....	58
DAFTAR PUSTAKA	60
LAMPIRAN	63

DAFTAR TABEL

Table 1. Penelitian Terdahulu	20
Table 2. Data Industri Pertambangan di Kompas 100	31
Tabel 3. Definisi Variabel	35
Tabel 4. Perhitungan Rasio	37

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. Kerangka Pemikiran Teoritis	29
Gambar 2. Uji Normalitas	41
Gambar 3. Uji Multikolinieritas	43
Gambar 4. Uji Heteroskedastisitas	44
Gambar 5. Uji Autokorelasi	46
Gambar 6. Uji Korelasi Berganda	48
Gambar 7. Uji Hipotesis	49
Gambar 8. Uji t ROA	51
Gambar 9. Uji t EPS	51
Gambar 10. Uji t NPM	52
Gambar 11. Uji t DER	53
Gambar 12. Uji t PBV	53
Gambar 13. Uji Statistik F	55
Gambar 14. Uji Koefisien Determinasi	56

