

DAFTAR ISI

Lembar Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xi
Intisari	xii
Abstract	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	10
1.3. Tujuan Penelitian	10
1.4. Manfaat Penelitian	11
1.5. Ruang Lingkup dan Batasan Masalah	11
1.6. Sistematika Penulisan	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1. LandasanTeori	13
2.1.1. Return Saham.....	13
2.1.2. Analisis Makroekonomi.....	20
2.1.2.1. Nilai tukar rupiah.....	21
2.1.2.2. Tingkat Suku Bunga Acuan.....	23

2.1.2.3. Tingkat Inflasi	24
2.1.2.4. Pengaruh Kurs Rupiah terhadap Return Saham	25
2.1.2.5. Pengaruh Tingkat Suku Bunga Acuan terhadap Return Saham	26
2.1.2.5. Pengaruh Tingkat Inflasi terhadap Return Saham	27
2.1.3. Analisis Fundamental	28
2.1.3.1. Profitabilitas	29
2.1.3.2. Struktur Modal	30
2.1.3.3. Price Earning Ratio	39
2.1.3.4. Profitabilitas dengan Return Saham	40
2.1.3.5. Struktur Modal dengan Return Saham	40
2.1.3.6. Price Earning Ratio dengan Return Saham	41
2.2. Penelitian Terdahulu	41
2.3. Kerangka Pemikiran	44
2.4. Hipotesis	47
BAB III METODE PENELITIAN	48
3.1. Desain Penelitian	48
3.2. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	48
3.2.1. Variabel Penelitian	48
3.2.2. Definisi Operasional Variabel	49
3.3. Populasi dan Sampel	52
3.4. Jenis, Sumber dan Metode Pengumpulan Data	54
3.4.1. Jenis Data	54
3.4.2. Sumber Data	54

3.5. Metode Pengumpulan Data.....	55
3.6. Metode Analisis Data	55
3.6.1. Statistik Deskriptif.....	56
3.6.2. Pengujian Asumsi Klasik.....	56
3.6.2.1. Uji Multikolienaritas.....	56
3.6.2.2. Uji Autokorelasi.....	57
3.6.2.3. Uji Heteroskedastisitas	57
3.6.3. Analisis Regresi Berganda.....	58
3.6.4. Pengujian Hipotesis	59
3.6.4.1. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t)	59
3.6.4.2. Uji Signifikansi/Pengaruh Simultan (Uji F)	59
3.6.4.3. Koefisien Determinasi (Uji R ²)	60
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	61
4.1 Gambaran Umum dan Deskriptif Statistik Objek Penelitian.....	61
4.1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	61
4.1.2 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian	62
4.1.2.1. Statistik deskriptif periode Q4 2005 – Q3 2007	62
4.1.2.2. Statistik deskriptif periode Q4 2005 – Q3 2007	64
4.1.2.3. Statistik deskriptif periode Q4 2005 – Q3 2007	66
4.2 Uji Asumsi Klasik.....	68
4.2.1 Uji Multikolinearitas.....	77
4.2.3 Uji Autokorelasi.....	68

4.2.4 Uji Heteroskedastisitas	69
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis.....	70
4.3.1 Uji Parsial (t test).....	70
4.3.2 Uji Pengaruh Simultan (F test)	75
4.3.3 Koefisien Korelasi dan Determinasi.....	75
4.4 Analisis	77
4.4.1 Periode Q4 2005 – Q3 2007	77
4.3.2 Periode Q4 2007 – Q3 2009	79
4.3.3 Periode Q4 2009 – Q3 2011	81
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	82
5.1 Kesimpulan	82
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	82
5.3 Implikasi	83
5.4 Saran	84
DAFTAR PUSTAKA.....	86
LAMPIRAN.....	91

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Tabulasi penelitian terdahulu	42
Tabel 3.1 Perhitungan Sampel Perusahaan	53
Tabel 4.1 Sampel Penelitian Perusahaan Property	61
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Periode Q4 2005 – Q3 2007	62
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Periode Q4 2007 – Q3 2009	64
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Periode Q4 2009 – Q3 2011	66
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas	68
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi	69
Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas	70
Tabel 4.8 Hasil Uji Parsial (t test).....	70
Tabel 4.9 Hasil Perhitungan F test.....	75
Tabel 4.10 Hasil Perhitungan Koefisien Determinasi (R^2).....	75
Tabel 4.11 Rangkuman Hasil Uji Hipotesis	76

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	46
Gambar 2.2 Penyusunan Hipotesis Periode	47