UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR ISI

Halaman Judul i

Lembar Pengesahan ii

Daftar Isi v

Daftar Tabel viii

Daftar Grafik ix

Daftar Lampiran x

Intisari xi

Abstract xii

BAB I PENDAHULUAN 1

1.1 Latar Belakang 1

1.2 Rumusan Masalah 8

1.3 Tujuan Penelitian 9

1.4 Manfaat Penelitian 10

1.5 Sistematika Penulisan 10

BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS 12

2.1 Landasan Teori 12

2.1.1 Pasar Modal 12

2.1.2 Saham 13

2.1.3 Return 15

2.1.4 Analisis Fundamental 17

2.1.4.1 Return On Assets (ROA) 19

2.1.4.2 Return On Equity (ROE) 19

2.1.4.3 Earning Per Share (EPS) 20

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

2.1.4.4 Price Earning Ratio (PER) 21
2.1.4.5 Price To Book Value (PBV) 22
2.1.4.6 Debt To Equity Ratio (DER) 23
2.2 Penelitian Terdahulu 24
2.3 Pengembangan Hipotesis 26
2.3.2 Pengaruh Return On Equity Terhadap Return Saham 28
2.3.3 Pengaruh Earning Per Share Terhadap Return Saham 29
2.3.4 Pengaruh Price Earning Ratio Terhadap Return Saham 30
2.3.5 Pengaruh Price To Book Value Terhadap Return Saham 31
2.3.6 Pengaruh Debt To Equity Ratio Terhadap Return Saham 32
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis 34
BAB III METODE PENELITIAN 35
3.1 Desain Penelitian 35
3.2 Jenis Dan Sumber Data 35
3.3 Metode Pengambilan Sampel 37
3.3.1 Populasi 37
3.3.2 Sampel 37
3.4 Variabel Penelitian Dan Definisi Operasional 37
3.4.1 Variabel Independen 38
3.4.2 Variabel Dependen 40
3.5 Statistik Deskriptif 41
3.6 Uji Asumsi Klasik 41
3.6.1 Uji Normalitas 41
3.6.2 Uji Multikolinearitas 42
3.6.3 Uji Heterokedastisitas 42
3.6.4 Uji Autokorelasi 43
3.7 Uji Hipotesis 44
3.7.1 Uji T (Parsial) 45
3.7.2 Uji F (Simultan) 45
3.7.3 Koefisien Determinasi (R^2) 46
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 48
4.1 Hasil Pengumpulan Data 48

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

4.2 Statistik Deskriptif 50
4.3 Uji Asumsi Klasik 51
4.3.1 Uji Normalitas Residual 51
4.3.2 Uji Multikolinearitas 53
4.3.3 Uji Heterokedastisitas 54
4.3.4 Uji Autokorelasi 56
4.4 Hasil Studi Empiris 56
4.4.1 Penyajian Hipotesis Menggunakan Uji T (Parsial) 57
4.4.2 Uji F (Simultan) 64
4.4.3 Koefisien Determinasi (R^2) 65
BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN, DAN SARAN 66
5.1 Kesimpulan 66
5.2 Keterbatasan Penelitian 68
5.3 Saran 68
DAFTAR PUSTAKA 70
LAMPIRAN 72

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Jumlah Sampel Penelitian 48
Tabel 4.2 Jumlah Sampel Penelitian Setelah Seleksi Z-Score 49
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif 50
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas Sebelum Seleksi Data Outlier 51
Tabel 4.5 Hasil Uji Normalitas Setelah Seleksi Data Outlier 52
Tabel 4.6 Hasil Uji Multikolinearitas 53
Tabel 4.8 Hasil Uji Autokorelasi Dengan Durbin-Watson 56
Tabel 4.9 Ringkasan Hasil Regresi 57

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.7 Hasil Uji Heterokedastisitas 55

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM (Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45 Bursa Efek Indonesia Periode 2000 - 2014)
FAISHAL RAFI ADHITYA, Mamduh M. Hanafi Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Sampel Perusahaan Sebelum Seleksi Data Outlier 72
Lampiran 2 Sampel Perusahaan Setelah Seleksi Data Outlier 72
Lampiran 3 Data Sampel Perusahaan Sebelum Seleksi Data Outlier 73
Lampiran 4 Data Sampel Perusahaan Setelah Seleksi Data Outlier..... 79
Lampiran 5 Statistik Deskriptif 82
Lampiran 6 Hasil Uji Normalitas Sebelum Seleksi Outlier 82
Lampiran 7 Hasil Uji Normalitas Setelah Seleksi Outlier 83
Lampiran 8 Hasil Uji Multikolinearitas 83
Lampiran 9 Hasil Uji Heterokedastisitas 84
Lampiran 10 Hasil Uji Autokorelasi dan Koefisien Determinasi 84
Lampiran 11 Hasil Uji-t (Parsial)..... 85
Lampiran 12 Hasil Uji-f (simultan)..... 85