

## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Pengesahan .....	ii
Daftar Isi.....	v
Daftar Tabel .....	viii
Daftar Grafik .....	ix
Daftar Lampiran .....	x
Intisari .....	xi
Abstract .....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
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
<b>BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS .....</b>	<b>12</b>
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

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
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>35</b>
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
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>48</b>
4.1 Hasil Pengumpulan Data.....	48

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
<b>BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN, DAN SARAN .....</b>	<b>66</b>
5.1 Kesimpulan .....	66
5.2 Keterbatasan Penelitian .....	68
5.3 Saran .....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>70</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>	<b>72</b>

## 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

## DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.7 Hasil Uji Heterokedastisitas .....	55
---	----

## 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