

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Berita Acara.....	iii
Halaman Pernyataan Keaslian Skripsi	iv
Abstrak	v
Motto.....	vii
Halaman Persembahan	viii
Kata Pengantar	x
Daftar Isi.....	xii
Daftar Tabel	xv
Daftar Gambar.....	xvi
Daftar Lampiran	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Batasan Penelitian	8
1.5 Manfaat Penelitian	9
1.6 Sistematika Pembahasan	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Tinjauan Teori.....	11
2.1.1 Pasar Modal.....	11
2.1.2 Saham.....	12
2.1.3 <i>Return</i> Saham.....	12
2.1.4 Kinerja Keuangan.....	14
2.1.5 Pengukuran Kinerja Keuangan	14

2.1.6 Analisis Rasio Keuangan	15
2.1.6.1 <i>Return On Asset</i> (ROA)	19
2.1.6.2 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER)	20
2.1.6.3 <i>Price to Book Value</i> (PBV)	21
2.1.6.4 <i>Earning Per Share</i> (EPS)	21
2.2 Tinjauan Penelitian Terdahulu	22
2.3 Kerangka Konseptual	25
2.4 Hipotesis Penelitian.....	26
2.4.1 Pengaruh <i>Return On Asset</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	26
2.4.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap <i>Return saham</i>	27
2.4.3 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	28
2.4.4 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	29
BAB III METODE PENELITIAN	31
3.1 Rancangan Penelitian	31
3.2 Populasi dan Sampel	31
3.3 Variabel Penelitian	32
3.3.1 Definisi Operasional Variabel.....	32
3.3.1.1 Variabel Dependensi.....	32
3.3.1.2 Variabel Independen	33
3.4 Prosedur Pengambilan Data	35
3.5 Model dan Teknik Analisis Data	35
3.5.1 Pengujian Asumsi Klasik	35
3.5.1.1 Uji Normalitas	36
3.5.1.2 Uji Multikolinieritas.....	36
3.5.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	37
3.5.1.4 Uji Autokorelasi	37
3.5.2 Analisis Regresi Berganda	38
3.5.3 Pengujian Hipotesis.....	39

3.5.3.1 Uji F	39
3.5.3.2 Uji t	40
BAB IV ANALISIS PENELITIAN DAN PEMBEHASAN	41
4.1 Data Penelitian	41
4.1.1 Hasil Perolehan Sampel	41
4.1.2 Analisis Deskriptif	42
4.2 Analisis dan Hasil Penelitian	44
4.2.1 Uji Asumsi Klasik	44
4.2.1.1 Uji Normalitas	44
4.2.1.2 Uji Multikolinieritas.....	45
4.2.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	46
4.2.1.4 Uji Autokorelasi	47
4.2.2 Analisis Regresi Linier Berganda	48
4.3 Uji Hipotesis dan Pembahasan.....	50
4.3.1 Koefisien Determinasi (R^2)	50
4.3.2 Uji F	50
4.3.3 Uji t	51
4.3.3.1 Pengujian Pengaruh ROA terhadap <i>Return Saham</i>	52
4.3.3.2 Pengujian Pengaruh DER terhadap <i>Return Saham</i>	53
4.3.3.3 Pengujian Pengaruh PBV terhadap <i>Return Saham</i>	53
4.3.3.4 Pengujian Pengaruh EPS terhadap <i>Return Saham</i>	54
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	56
5.1 Kesimpulan	56
5.2 Keterbatasan	56
5.3 Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN.....	61