

DAFTAR ISI

	Halaman
JUDUL PENELITIAN	i
ABSTRAK	iii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	v
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB 1 PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah	8
C. Pembatasan Masalah	9
D. Perumusan Masalah	9
E. Kegunaan Penelitian.....	10
BAB II KAJIAN TEORETIK	
A. Deskripsi Konseptual	11
1. Saham	11
a. Pengertian Saham	11
b. Jenis-jenis Saham	12
c. Penggolongan Saham	12

2. <i>Return</i> Saham	14
a. Pengertian <i>Return</i> Saham	14
b. Jenis-jenis <i>Return</i> Saham	16
c. Komponen Utama <i>Return</i> Saham	17
d. Faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham.....	20
3. Profitabilitas	21
a. Pengertian Profitabilitas.....	21
b. Indikator Profitabilitas.....	22
4. Likuiditas	24
a. Pengertian Likuiditas	24
b. Dimensi Likuiditas	25
B. Hasil Penelitian yang Relevan	30
C. Kerangka Teoretik.....	36
1. Pengaruh profitabilitas terhadap <i>Return</i> Saham	36
2. Pengaruh Likuiditas terhadap <i>Return</i> Saham	38
3. Pengaruh profitabilitas dan likuiditas terhadap return saham	40
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	41

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Tujuan Penelitian	42
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	42
C. Metode Penelitian.....	43
D. Populasi dan Sampling	43
E. Variabel Penelitian dan Pengukurannya	45

F. Teknik Pengumpulan Data	47
G. Teknik Analisis Data.....	48
1. Uji Normalitas	48
2. Uji Asumsi Klasik	49
2.3 Uji Multikolinearitas	49
2.2 Uji Heteroskedastisitas	50
2.3 Uji Autokorelasi	50
3. Analisis Regresi Linear Berganda	51
4. Uji Hipotesis.....	52
a. Uji F.....	52
b. Uji T.....	54

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Deskripsi Data.....	56
B. Pengujian Hipotesis.....	62
1. Uji Persyaratan Analisis	62
2. Uji Asumsi Klasik	65
a. Uji Multikolinearitas	65
b. Uji Heterokedastisitas	66
c. Uji Autokorelasi	67
3. Analisis Regresi Linear Berganda.....	68
4. Uji Hipotesis	67
a. Uji f	69
b. Uji t	70

c. Koefisien Determinasi.....	71
C. Pembahasan.....	70
a. Analisis Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return</i> Saham	72
b. Analisis Pengaruh Likuiditas terhadap <i>Return</i> Saham.....	74
c. Analisis Pengaruh Profitabilitas dan Likuiditas terhadap <i>Return</i> Saham.....	77
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN	80
A. Kesimpulan	80
B. Implikasi.....	81
C. Saran	82
DAFTAR PUSTAKA	84
LAMPIRAN.....	88
RIWAYAT HIDUP	104

DAFTAR TABEL

Tabel II.1 <i>Reviwe</i> Penelitian-penelitian Terdahulu	31
Tabel IV.1 Deskripsi Data.....	56
Tabel IV.2 Frekuensi Return Saham	57
Tabel IV.3 Frekuensi Profitabilitas	59
Tabel IV.4 Frekuensi Likuiditas	60
Tabel IV. 5 Normalitas Data	62
Tabel IV.6 Uji Multikolinearitas	64
Tabel IV.7 Uji Heteroskedastisitas	65
Tabel IV.8 Aturan Keputusan Uji Durbin Watson.....	66
Tabel IV.9 Uji Autokorelasi.....	66
Tabel IV.10 Analisis Regresi Linear Berganda	67
Tabel IV.11 Uji f	68
Tabel IV.12 Uji t	69
Tabel IV.13 Koefisien Determinasi	71

DAFTAR GAMBAR

Gambar II.1 Kerangka Pemikiran	39
Gambar IV.1 Histogram Return Saham	58
Gambar IV.2 Histogram Profitabilitas	59
Gambar IV.3 Histogram Likuiditas	61
Gambar IV.4 Normal Probability Plot	63