

## DAFTAR ISI

|  |      |
|--|------|
| <b>ABSTRAK</b> .....   | ii   |
| <b>ABSTRACT</b> .....  | iii  |
| <b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI</b> .....                                   | iv   |
| <b>PERNYATAAN ORISINALITAS</b> .....                                     | v    |
| <b>KATA PENGANTAR</b> .....  | vi   |
| <b>DAFTAR ISI</b> .....  | viii |
| <b>DAFTAR TABEL</b> .....  | xi   |
| <b>DAFTAR GAMBAR</b> .....   | xii  |
| <b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....   | xiii |
| <b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....   | 1    |
| 1.1. Latar Belakang Masalah .....  | 1    |
| 1.2. Rumusan Masalah .....   | 6    |
| 1.3. Tujuan Penelitian.....  | 7    |
| 1.4. Manfaat Penelitian.....   | 7    |
| <b>BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN<br/>HIPOTESIS</b> ..... | 8    |
| 2.1. Kajian Pustaka .....  | 8    |
| 2.1.1. Indeks SRI KEHATI .....   | 8    |
| 2.1.2. <i>Return</i> Saham .....   | 10   |
| 2.1.3. Suku Bunga Bank Indonesia .....                                   | 12   |
| 2.1.4. Kurs .....  | 15   |

|  |           |
|--|-----------|
| 2.1.5. Pertumbuhan Ekonomi .....                     | 17        |
| 2.1.6. ROI .....                                     | 25        |
| 2.1.7. DER .....                                     | 28        |
| 2.2. <i>Review</i> Penelitian Terdahulu .....        | 31        |
| 2.3. Kerangka Pemikiran .....                        | 36        |
| 2.4. Hipotesis .....                                 | 39        |
| <b>BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN .....</b> | <b>41</b> |
| 3.1. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....         | 41        |
| 3.1.1. Objek Penelitian .....                        | 41        |
| 3.1.2. Periode Penelitian .....                      | 41        |
| 3.2. Metode Penelitian .....                         | 42        |
| 3.3. Operasionalisasi Variabel Penelitian .....      | 43        |
| 3.3.1. Variabel dependen .....                       | 43        |
| 3.3.2. Variabel Independen.....                      | 43        |
| 3.4. Metode Pengumpulan Data .....                   | 47        |
| 3.5. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....       | 48        |
| 3.6. Metode Analisis .....                           | 49        |
| 3.7. Pendekatan Model Estimasi.....                  | 50        |
| 3.8. Uji Asumsi Klasik .....                         | 51        |
| 3.9. Uji Hipotesis .....                             | 54        |
| <b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>   | <b>55</b> |
| 4.1. Analisis Deskriptif.....                        | 55        |
| 4.2. Hasil Penelitian dan Pembahasan.....            | 57        |

|   |           |
|---|-----------|
| 4.2.1. Uji Normalitas .....               | 57        |
| 4.2.2. Uji Multikolinieritas .....        | 58        |
| 4.2.3. Uji Heteroskedastisitas .....      | 59        |
| 4.2.4. Uji Autokorelasi .....             | 59        |
| 4.3. Pembahasan .....                     | 60        |
| 4.3.1. Analisis Regresi.....              | 62        |
| 4.4. Hasil Uji Hipotesis .....            | 63        |
| 4.4.1. Hasil Uji t-statistik.....         | 64        |
| 4.5. Uji - F.....                         | 71        |
| 4.6. Koefisien Determinasi ( $R^2$ )..... | 71        |
| <b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>    | <b>73</b> |
| 5.1. Kesimpulan .....                     | 73        |
| 5.2. Implikasi .....                      | 74        |
| 5.3. Saran .....                          | 74        |
| DAFTAR PUSTAKA.....                       | 73        |
| <b>LAMPIRAN-LAMPIRAN.....</b>             | <b>73</b> |
| RIWAYAT HIDUP                             |           |

## DAFTAR TABEL

| Tabel | Judul                             | Halaman |
|-------|-----------------------------------|---------|
| 2.1   | Matriks Penelitian Terdahulu..... | 33      |
| 3.1   | Operasionalisasi Variabel.....    | 46      |
| 4.1   | Statistik Deskriptif.....         | 55      |
| 4.2   | Hasil Uji Multikolinieritas.....  | 58      |
| 4.3   | Hasil Uji White.....              | 59      |
| 4.4   | Hasil Uji Autokorelasi.....       | 60      |
| 4.5   | Hasil Uji Chow Test.....          | 61      |
| 4.6   | Regresi Data Panel.....           | 62      |

## DAFTAR GAMBAR

| Gambar | Judul                            | Halaman |
|--------|----------------------------------|---------|
| 2.1    | Kerangka Pemikiran.....          | 39      |
| 4.1    | Gambar Hasil Uji Normalitas..... | 58      |

## DAFTAR LAMPIRAN

|            |                               |    |
|------------|-------------------------------|----|
| Lampiran 1 | Data Populasi Perusahaan..... | 81 |
| Lampiran 2 | Data Sampel Perusahaan.....   | 82 |
| Lampiran 3 | Statistik Deskriptif.....     | 83 |
| Lampiran 4 | Uji Normalitas.....           | 84 |
| Lampiran 5 | Uji Autokorelasi.....         | 85 |
| Lampiran 6 | Uji Multikolenieritas.....    | 86 |
| Lampiran 7 | Uji Heteroskedastisitas.....  | 87 |
| Lampiran 8 | Chow Test.....                | 88 |
| Lampiran 9 | Analisis Regresi.....         | 89 |