

DAFTAR ISI

	Hal
JUDUL	i
ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
PERNYATAAN ORISINALITAS	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR LAMPIRAN	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	10
C. Pembatasan Masalah.....	12
D. Perumusan Masalah.....	12
E. Kegunaan Penelitian.....	13
BAB II KAJIAN TEORITIK	
A. Deskripsi Konseptual.....	15
1. Return Saham.....	17
2. Rasio Profitabilitas.....	20
a. EPS (<i>Earning Per Share</i>).....	20

b. NPM (<i>Net Profit Margin</i>).....	21
c. ROE (<i>Return of Equity</i>).....	22
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	24
C. Kerangka Teoretik.....	27
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	30

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Tujuan Penelitian.....	32
B. Tempat dan Waktu Penelitian atau Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	32
C. Metode Penelitian.....	33
D. Populasi dan Sampling.....	33
E. Teknik Pengumpulan Data atau Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	34
1. Teknik Pengumpulan Data.....	34
2. Operasional Variabel Penelitian.....	35
F. Teknik Analisis Data.....	39
1. Metode Analisis.....	39
a. Statistik Deskriptif.....	39
b. Analisis Data Panel.....	40
2. Pengujian Asumsi Klasik.....	45
a. Uji Normalitas.....	45
b. Uji Multikolinieritas.....	47
c. Uji Heteroskedastisitas.....	48

d. Uji Autokorelasi.....	49
e. Regresi Linier Berganda.....	50
3. Pengujian Hipotesis.....	51
a. Uji Statistik t.....	52
b. Uji Statistik F	53
4. Koefisien Determinasi.....	54

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Deskripsi Data.....	55
B. Hasil dan Pembahasan.....	63
1. Regresi Data Panel.....	63
a. Uji Chow Test.....	63
b. Uji Regresi Linear.....	64
c. Uji Multikolinearitas.....	66
d. Uji Hipotesis Pengaruh Variabel Independen Terhadap Variabel Dependen.....	67
1) Pengujian Hipotesis Pertama Pengaruh EPS Terhadap Return Saham.....	68
2) Pengujian Hipotesis Kedua Pengaruh NPM Terhadap Return Saham.....	70
3) Pengujian Hipotesis Ketiga Pengaruh ROE Terhadap Return Saham.....	72
4) Pengujian Hipotesis Keempat (Uji Simultan).....	74
e. Koefisien Determinasi (R ²).....	75

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan.....76

B. Saran.....77

DAFTAR PUSTAKA.....xv

LAMPIRAN-LAMPIRAN.....xix

DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....xxxvii

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul	Halaman
Lampiran 1	Daftar Perusahaan yang menjadi Sampel Penelitian.....	xii
Lampiran 2	Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	xiv
Lampiran 3	Hasil Uji Normalitas.....	xv
Lampiran 4	Hasil Uji Multikolinearitas.....	xii
Lampiran 5	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	xiv
Lampiran 6	Hasil Uji Chow.....	xv
Lampiran 7	Hasil Common Effect.....	xii
Lampiran 8	Hasil Fixed Effect.....	xiv
Lampiran 9	Hasil Common Effect dari data log ln.....	xv
Lampiran 10	Hasil Uji Parsial.....	xii
Lampiran 11	Data Panel.....	xiv
Lampiran 12	Data Outlier.....	xv
Lampiran 13	Data Panel log ln.....	xii

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
II.1	Penelitian Terdahulu.....	26
III.1	Operasional Variabel Penelitian.....	38
III.2	Tabel Uji Statistik Durbin Watson (<i>d</i>).....	50
IV.1	Statistik Deskriptif.....	55
IV.2	Chow Test.....	63
IV.3	Hasil Regresi Data Panel.....	65
IV.4	Uji Multikolinearitas.....	66
IV.5	Hasil Uji Parsial.....	67

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
II.1	Kerangka Teoretik.....	30