

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN ORIGINALITAS	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
2.1 Pasar Modal.....	11
2.1.1 Definisi Pasar Modal.....	11
2.1.2 Macam-macam Pasar Modal.....	12
2.1.3 Pelaku Pasar Modal.....	15
2.2 Saham.....	21
2.2.1 Definisi Saham.....	21
2.2.2 Jenis-jenis Saham.....	22
2.2.3 Manfaat dan Risiko Kepemilikan Saham.....	25
2.2.4 Analisis Saham.....	26
2.2.5 Harga Saham.....	27
2.2.6 Return Saham.....	30

2.3 Hubungan Variabel Bebas dengan Variabel Terikat.....	32
2.4 Penelitian Terdahulu.....	36
2.5 Kerangka Pemikiran.....	43
2.6 Hipotesis.....	47

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	48
3.1.1 Objek Penelitian.....	48
3.1.2 Periode Penelitian.....	48
3.2 Metode Penelitian	48
3.3 Operasional Variabel Penelitian.....	48
3.3.1 Return Saham.....	49
3.3.2 Earning Per Share.....	49
3.3.3 Debt to Equity Ratio.....	50
3.3.4 Return On Equity.....	51
3.3.5 Price to Book Value.....	51
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	52
3.5 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	52
3.6 Metode Analisis.....	53
3.6.1 Analisis Model Regresi Data Panel.....	53
3.6.2 Pengujian Model.....	54
3.6.3 Uji Asumsi Klasik.....	55
3.6.3.1 Uji Normalitas.....	55
3.6.3.2 Uji Heteroskedastisitas.....	56
3.6.3.3 Uji Multikolinearitas.....	56
3.6.3.4 Uji Autokorelasi.....	56
3.6.4 Pengujian Hipotesis.....	57
3.6.5 Uji Hipotesis.....	57
3.6.5.1 Uji Koefisien Determinasi.....	57

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskriptif Unit Analisis	59
4.2 Hasil Uji Asumsi Klasik	59
4.2.1 Normalitas	62
4.2.2 Uji Multikolinearitas	62
4.2.3 Uji Heterokedastis	63
4.2.4 Uji Autokorelasi	64
4.1 Pembahasan.....	65
4.3.1 Hasil Uji Model Data Panel	65
4.3.2 Hasil Uji Hipotesis	67
4.3.2.1 Hasil Uji t-Statistik.....	67
4.3.2.2 Koefisien Determinasi.....	71

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	73
5.2 Saran	74

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
Tabel 2.1	Review Penelitian Terdahulu	41
Tabel 4.1	Tabel Descriptive Statistik	59
Tabel 4.2	Hasil Uji Multikolinearitas	63
Tabel 4.3	Hasil Uji Heteroskedastisitas	63
Tabel 4.4	Hasil Uji Autokorelasi	64
Tabel 4.5	Hasil Uji Chow	65
Tabel 4.7	Hasil Regresi Data <i>Pooled Least square</i>	67

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
Gambar 2.1	Kerangka Pemikiran	46

DAFTAR LAMPIRAN

Judul Lampiran	Nomor Lampiran
Daftar Perusahaan yang Menjadi Sample Penelitian	Lampiran 1
Tabel Uji Normalitas	Lampiran 2
Tabel Uji Multikolinearitas	Lampiran 3
Tabel Uji Heteroskedastisitas	Lampiran 4
Tabel Uji Autokortelasi	Lampiran 5
Tabel Uji Chow	Lampiran 6
Tabel Uji <i>Pooled Least Square</i>	Lampiran 7