

DAFTAR ISI

JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PERNYATAAN ORIGINALITAS	iii
ABSTRAK	iv
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	5
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Kegunaan Penelitian.....	6
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN	
HIPOTESIS	7
2.1 Kajian Pustaka	7
2.1.1 Saham	7
2.1.2 <i>Return Saham</i>	10
2.1.3 <i>Price To Book Value (PBV)</i>	14
2.1.4 <i>Net Profit Margin (NPM)</i>	19
2.2 Penelitian Terdahulu.....	23
2.3 Kerangka Pemikiran	27
2.4 Hipotesis	29
BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN	30
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	30
3.1.1 Objek Penelitian.....	30
3.1.2 Waktu Penelitian	30
3.2 Metode Penelitian.....	30
3.3 Operasional Variabel Penelitian	32
3.3.1 Variabel dependen (Y)	32
3.3.2 Variabel Independen (X)	33
3.4 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	34
3.5 Metode Pengumpulan Data	35
3.6 Metode Analisis.....	36
3.6.1 Uji Asumsi Klasik	36
3.6.1.1 Uji Normalitas	37
3.6.1.2 Uji Multikolinieritas.....	38
3.6.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	39
3.6.1.4 Uji Autokorelasi.....	40
3.6.2 Uji Hipotesis	41

3.6.2.1 Model Regresi Linear Berganda	41
3.6.2.2 Koefisien Determinasi (R^2)	42
3.6.2.3 Uji Signifikan Simultan (Uji Statistik F)	42
3.6.2.4 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji Statistik t)	43
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	45
4.1 Deskripsi Unit Analisis/Observasi	45
4.1.1 Analisis Deskriptif.....	46
4.1.2 <i>Price To Book Value</i> (PBV).....	46
4.1.3 <i>Net Profit Margin</i> (NPM).....	46
4.1.4 <i>Return Saham</i>	47
4.2 Uji Asumsi Klasik	47
4.2.1 Uji Normalitas	48
4.2.2 Uji Multikolinearitas	49
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas	50
4.2.4 Uji Autokorelasi.....	52
4.4 Uji Regresi Linier Berganda.....	53
4.4.1 Model Regresi Linier Berganda.....	53
4.5 Koefisien Determinasi (R^2)	54
4.6 Uji Hipotesis	55
4.6.1 Uji Signifikan Simultan (Uji Statistik F)	55
4.6.2 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji Statistik t).....	56
4.7 Pembahasan Hasil Penelitian.....	58
4.7.1 Pengaruh PBV terhadap <i>Return Saham</i>	58
4.7.2 Pengaruh NPM terhadap <i>Return Saham</i>	59
4.7.3 Pengaruh PBV dan NPM terhadap <i>Return Saham</i>	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	62
5.1 Kesimpulan.....	62
5.1.1 Kesimpulan Penelitian	62
5.1.2 Keterbatasan.....	63
5.2 Saran	64
DAFTAR PUSTAKA.....	65
LAMPIRAN	67
RIWAYAT HIDUP	85

DAFTAR TABEL

Tabel :	Judul	Halaman
4.1	Deskripsi Statistik Variabel Penelitian.....	46
4.2	<i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i>	48
4.3	Uji Multikolinieritas.....	50
4.4	Uji Heterokedastisitas	52
4.5	Uji Autorelasi	53
4.6	Uji F.....	55
4.7	<i>Coefficients</i>	56

DAFTAR GAMBAR

Gambar :	Judul	Halaman
2.1	Kerangka Berpikir.....	29
4.1	<i>P-P Plot of Regresion Standardized Residual</i>	49
4.2	<i>Scatterplot</i>	51

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran :	Judul	Halaman
1	<i>Npar Test</i> Data Sebelum <i>Boxplot</i>	67
2	<i>Stem-and-leaf Plot</i> Return Saham	68
3	<i>Stem-and-leaf Plot</i> NPM	69
4	<i>Stem-and-leaf Plot</i> PBV	70
5	<i>Npar Test</i> Data Sesudah <i>Boxplot</i>	71
6	<i>Regression Test</i>	72
7	<i>Regression Test</i>	73
8	<i>Chart</i>	74
9	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	75
10	Daftar Sampel Sebelum <i>Outlier</i>	76
11	Daftar Sampel Yang Dikeluarkan	78
12	Daftar Sampel Yang Digunakan	79
13	Perhitungan <i>Return</i> Saham	80
14	Perhitungan PBV	82
15	Perhitungan NPM.....	84