

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR PERSETUJUAN UJIAN SIDANG SKRIPSI	ii
PERNYATAAN ORIGINALITAS	iii
ABSTRAK	iv
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	8
1.4 .Manfaat Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA , KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
2.1 Kajian Pustaka.....	11
2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	11
2.1.2 Hukum Permintaan dan Penawarn.....	12
2.1.3 Investasi Saham.....	13

2.1.4	<i>Return Saham</i>	15
2.1.5	Rasio Profitabilitas	19
2.1.6	Pengertian <i>Return On Asset</i> (ROA)	21
2.1.7	Pengertian <i>Earning Per Share</i> (EPS)	22
2.1.8	Pengertian Rasio Penilaian	23
2.1.9	Pengertian <i>Price Earning Ratio</i> (PER)	24
2.2	Review Penelitian Terdahulu.....	26
2.2.1	Hubungan ROA dengan <i>return</i> saham	26
2.2.2	Hubungan EPS dengan <i>return</i> saham	28
2.2.3	Hubungan PER dengan <i>return</i> saham	31
2.3	Kerangka Pemikiran.....	34
2.4	Hipotesis.....	37

BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	38
3.2	Metode Penelitian.....	38
3.3	Variabel Penelitian dan pengukurannya	39
3.3.1	<i>Return Saham</i>	40
3.3.2	<i>Return On Asset</i> (ROA).....	40
3.3.3	<i>Earning Per Share</i> (EPS)	41
3.3.4	<i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	41
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	41
3.5	Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	42
3.6	Metode Analisis.....	44

BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1	Statistik Deskriptif	52
4.2	Hasil Penelitian dan Pembahasan	54
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian	67
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1	Kesimpulan	76
5.2	Saran	77
DAFTAR PUSTAKA	79
LAMPIRAN-LAMPIRAN		

DAFTAR TABEL

		Halaman
TABEL 3.1	Prosedur Pemilihan Sampel	43
TABEL 3.2	Perusahaan yang Menjadi Sampel Penelitian	43
TABEL 4.1	<i>Descriptive Statistics</i>	53
TABEL 4.2	Tabel Hasil Uji Normalitas	55
TABEL 4.3	Tabel Hasil Uji Multikolonieritas	57
TABEL 4.4	Tabel Hasil Uji Autokolerasi	58
TABEL 4.5	Tabel Hasil Uji Heteroskedastisitas	60
TABEL 4.6	Tabel Hasil Uji Koefisien Determinasi	61
TABEL 4.7	Tabel Hasil Uji Regresi Linier Berganda	62
TABEL 4.8	Tabel Hasil Uji t	64
TABEL 4.9	Tabel Hasil Uji F	66

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
GAMBAR 2.1 Kerangka Berfikir	37
GAMBAR 4.1 Hasil Pengujian Normalitas Dengan P-Plot.....	56
GAMBAR 4.2 Hasil Pengujian Heteroskedastisitas-Pola Grafik Scatterplot	60

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
LAMPIRAN 1 Laporan Keuangan PT. ASII	82
LAMPIRAN 2 Perhitungan <i>Return On Asset</i> (X_1)	95
LAMPIRAN 3 Perhitungan <i>Earning Per Share</i> (X_2)	96
LAMPIRAN 4 Perhitungan <i>Price Earning Ratio</i> (X_3)	97
LAMPIRAN 5 Perhitungan <i>Return Saham</i> (X_4)	98
LAMPIRAN 6 Hasil Uji SPSS	99