

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN SRIPSI	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRAK	vi
<i>ABSTRACT</i>	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	xvi
DAFTAR GAMBAR	xx
DAFTAR LAMPIRAN.....	xxi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	18
1.3 Tujuan Dan Kegunaan Penelitian.....	19
1.4 Sistematika Penulisan	21

BAB II TELAAH PUSTAKA	23
2.1 Landasan Teori	23
2.1.1 Pasar Modal.....	23
2.1.2 Investasi	24
2.1.3 Saham.....	25
2.1.4 <i>Return Saham</i>	26
2.1.5 Pemodal (Investor).....	29
2.1.6 Perilaku dan Strategi Investor	29
2.1.7 Indeks LQ 45.....	31
2.1.8 <i>Arbitrage Pricing Theory</i>	31
2.1.9 <i>Signalling Theory</i>	32
2.2 Analisis Faktor – Faktor Fundamental	33
2.2.1 . <i>Debt to Equity Ratio</i>	34
2.2.2 <i>Current Ratio</i>	35
2.2.3 <i>Return On Equity</i>	36
2.2.4 <i>Total Asset Turnover</i>	37
2.3 Pengaruh Faktor – Faktor Fundamental terhadap <i>Return Saham</i>	38
2.3.1 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	38
2.3.2 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	39
2.3.3 Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	40

2.3.4 Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> terhadap <i>Return Saham</i>	41
2.4 Penelitian Terdahulu	42
2.5 Kerangka Pemikiran	52
2.6 Hipotesis	52
BAB III METODE PENELITIAN	53
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	53
3.1.1 Variabel Terikat (<i>dependent variabel</i>)	53
3.1.2 Variabel Bebas (<i>independent variabel</i>)	54
3.2 Populasi dan Sampel	59
3.3 Jenis dan Sumber Data	62
3.4 Metode Pengumpulan Data	63
3.5 Metode Analisis	64
3.5.1 Analisis Angka Indeks	64
3.5.2 Uji Alat Ukur	65
3.5.2.1 Uji validitas	65
3.5.2.2 Uji Reliabilitas	66
3.5.3 Analisis Regresi Berganda	66
3.5.4 Uji Ketepatan Model (<i>Goodness of Fit</i>).....	68
3.5.4.1 Koefisien Determinasi (R^2).....	68
3.5.4.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	70
3.5.4.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	71
3.5.5 Uji Asumsi Klasik.....	72
3.5.5.1 Uji Multikolinearitas	72

3.5.5.2 Uji Autokorelasi	73
3.5.5.3 Uji Heterokedastisitas	74
3.5.5.4 Uji Normalitas	74
3.5.6 Pengujian Hipotesis	75
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	77
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	77
4.2 Analisis Data	81
4.2.1 Statistik Deskriptif Variabel	81
4.2.2 Hubungan antara Masing – Masing Variabel dengan Variabel Dependen	88
4.2.2.1 <i>Debt Equity Ratio</i> (DER) dengan <i>Return Saham</i>	88
4.2.2.2 <i>Current Ratio</i> (CR) dengan <i>Return Saham</i>	91
4.2.2.3 <i>Return On Equity</i> (ROE) dengan <i>Return Saham</i>	94
4.2.2.4 <i>Total Asset Turnover</i> (TAT) dengan <i>Return Saham</i>	97
4.2.3 Statistik Tabulasi Silang (<i>Cross Tab</i>)	100
4.2.3.1 <i>Debt Equity Ratio</i> (DER) dengan <i>Return Saham</i>	100
4.2.3.2 <i>Current Ratio</i> (CR) dengan <i>Return Saham</i>	102
4.2.3.3 <i>Return On Equity</i> (ROE) dengan <i>Return Saham</i>	104
4.2.3.4 <i>Total Asset Turnover</i> (TAT) dengan <i>Return Saham</i>	107
4.2.4 Persamaan Regresi Linear Berganda	109
4.2.5 Uji Ketepatan Model (<i>Goodness of Fit</i>)	112
4.2.5.1 Koefisien Determinasi	112
4.2.5.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	114

4.2.5.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	115
4.2.6 Pengujian Asumsi Klasik.....	116
4.2.6.1 Uji Multikolinearitas	116
4.2.6.2 Uji Autokorelasi	118
4.2.6.3 Uji Heterokedastisitas	120
4.2.6.4 Uji Normalitas	121
4.2.7 Pengujian Hipotesis	124
4.3 Interpretasi Hasil Pengujian Statistik.....	127
4.3.1 Pengaruh DER terhadap <i>Return Saham</i>	127
4.3.2 Pengaruh CR terhadap <i>Return Saham</i>	130
4.3.3 Pengaruh ROE terhadap <i>Return Saham</i>	132
4.3.4 Pengaruh TAT terhadap <i>Return Saham</i>	134
BAB V PENUTUP.....	137
5.1 Simpulan.....	137
5.2 Keterbatasan Penelitian	141
5.3 Saran	143
5.3.1 Implikasi Kebijakan.....	143
5.3.2 Saran Penelitian yang Akan Datang	145
DAFTAR PUSTAKA	146
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	150