

## DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN .....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN .....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	v
ABSTRAK .....	vi
KATA PENGANTAR .....	viii
DAFTAR TABEL .....	xiv
DAFTAR GAMBAR .....	xv
DAFTAR LAMPIRAN .....	xvi
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	8
1.4 Sistematika Penulisan .....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu .....	11
2.1.1 Arbitrage Pricing Theory (APT) .....	13
2.1.2 Teori Sinyal .....	13

2.1.3 <i>Pecking Order Theory</i> .....	13
2.1.4 Investasi di Pasar Modal .....	16
2.1.5 <i>Return Saham</i> .....	17
2.1.7 <i>Komponen Return</i> .....	19
2.1.8 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Pergerakan <i>Return Saham</i> .....	19
2.1.8.1 Analisis Fundamental .....	20
2.1.8.2 Analisis Teknikal.....	22
2.1.9 Laporan Keuangan.....	22
2.1.10 Analisis Trend .....	26
2.1.11 Penelitian Terdahulu.....	26
2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis .....	33
2.2.1 Pengaruh Antar Variabel .....	33
2.2.1.1 Pengaruh DTA terhadap <i>Return Saham</i> .....	34
2.2.1.2 Pengaruh EPS terhadap <i>Return Saham</i> .....	35
2.2.1.3 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap <i>Return Saham</i> .....	35
2.3 Hipotesis .....	37
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b> .....	39
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	39
3.2 Populasi dan Sampel.....	42
3.3 Jenis dan Sumber Data .....	45
3.4 Metode Pengumpulan Data .....	45

3.5 Metode Analisis Data .....	46
3.5.1 Pengujian asumsi klasik .....	47
3.5.1.1 Uji Normalitas .....	47
3.5.1.2 Uji Multikolinieritas .....	47
3.5.1.3 Uji Heterokedastisitas.....	49
3.5.1.4 Uji Autokorelasi .....	49
3.5.2 Uji Statistik.....	50
3.5.2.1 Koefisien Determinasi.....	50
3.5.2.2 Pengujian Hipotesis.....	51
3.5.2.3 Uji Statistik F .....	51
3.5.3.3 Uji t .....	52
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>54</b>
4.1 Deskripsi Obyek Penelitian .....	54
4.2 Pengujian Asumsi Klasik .....	59
4.2.1 Uji Multikolinieritas.....	60
4.2.2 Uji Heterokedastisitas .....	61
4.2.3 Uji Normalitas.....	62
4.2.4 Uji Autokorelasi .....	64
4.3 Hasil Analisis Regresi Berganda .....	65
4.4 Pengujian Hipotesis .....	67
4.4.1 Uji Statistik t.....	67
4.4.2 Uji Statistik F.....	70
4.4.3 Uji Koefisien Determinasi .....	72

4.5 Pembahasan .....	73
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....	77
5.1 Kesimpulan.....	79
5.2 Implikasi Kebijakan.....	80
5.3 Keterbatasan Penelitian .....	80
5.4 Saran .....	80
5.3.1 Saran bagi Investor .....	80
5.3.2 Saran Penelitian Mendatang .....	80
DAFTAR PUSTAKA .....	82
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	86