

## DAFTAR ISI

Halaman Judul .....	i
Sertifikat .....	ii
Persetujuan Draft Tesis .....	iii
Pengesahan Tesis .....	iv
Abstract .....	v
Abstraksi .....	vi
Kata Pengantar .....	vii
Daftar Tabel .....	xii
Daftar Gambar .....	xiii
<b>Bab I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	7
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian .....	9
1.3.1 Tujuan Penelitian .....	9
1.3.2 Kegunaan Penelitian .....	10
<b>Bab II TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>11</b>
2.1 Landasan Teori .....	11
2.1.1 Konsep Return Saham .....	11
2.1.2 Nilai Kapitalisasi Pasar .....	14
2.1.3 Faktor-faktor Fundamental .....	14
2.1.2.1 Pengaruh ROA terhadap Return Saham .....	16

2.1.2.2	Pengaruh NPM terhadap Return Saham .....	17
2.1.2.3	Pengaruh DER terhadap Return Saham .....	18
2.1.2.4	Pengaruh PBV terhadap Return Saham .....	19
2.1.2.5	Pengaruh Nilai Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham .....	19
2.2	Penelitian Terdahulu .....	20
2.3	Kerangka Pemikiran .....	25
2.4	Hipotesis .....	26
<b>Bab III</b>	<b>METODE PENELITIAN .....</b>	<b>27</b>
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	27
3.1.1	Variabel Terikat .....	27
3.1.2	Variabel Bebas .....	28
3.2	Populasi dan Sampel .....	32
3.3	Jenis dan Sumber Data .....	33
3.4	Metode Pengumpulan Data .....	34
3.5	Metode Analisis Data .....	35
3.5.1	Analisis Regresi Linear Berganda .....	35
3.5.2	Pengujian Asumsi Klasik .....	35
3.5.2.1	Uji Multikolinieritas .....	36
3.5.2.2	Uji Autokorelasi .....	37
3.5.2.3	Uji Heteroskedastisitas .....	38
3.5.2.4	Uji Normalitas Data .....	39
3.5.3	Pengujian Hipotesis .....	40
3.5.3.1	Pengujian Hipotesis secara Parsial .....	40
3.5.3.2	Pengujian Hipotesis secara Simultan .....	40

Bab IV	HASIL DAN PEMBAHASAN .....	44
4.1	Deskripsi Variabel Penelitian .....	44
4.2	Analisis Data .....	48
4.2.1	Pengujian Asumsi Klasik.....	48
4.2.1.1	Pengujian Normalitas Data .....	49
4.2.1.2	Pengujian Multikolinearitas .....	51
4.2.1.3	Pengujian Heteroskedastisitas .....	53
4.2.1.4	Pengujian Autokorelasi .....	53
4.2.2	Analisis Regresi dan Pengujian Hipotesis .....	54
4.2.3	Pengujian Koefisien Determinasi .....	55
4.2.4	Overall Model Test .....	56
4.2.5	Pengujian Signifikansi untuk Pengaruh Parsial ( Uji t ) ..	57
4.3	Pembahasan .....	59
Bab V	PENUTUP .....	62
5.1	Kesimpulan .....	62
5.2	Implikasi Kebijakan .....	63
5.3	Keterbatasan Penelitian ... ..	63
5.4	Agenda Penelitian Mendatang .....	64
	Daftar Referensi .....	65
	Lampiran	