

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul.....	i
Sertifikasi	ii
Halaman Pengesahan Tesis	iii
<i>Abstract</i>	iv
Abstrak	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Tabel	xi
Daftar Gambar.....	xii
Daftar Rumus	xiii
Daftar Lampiran	xiv

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	13
1.3 Tujuan Penelitian	15
1.4 Kegunaan Penelitian	16

BAB II TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL

2.1 Telaah Pustaka	18
2.1.1 <i>Arbitrage Pricing Theory</i> (APT)	18
2.1.2 <i>Return Saham</i>	19
2.1.3 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER)	21
2.1.4 <i>Earning Per Share</i> (EPS)	22
2.1.5 <i>Net Profit Margin</i> (NPM)	23
2.1.6 <i>Price to Book Value</i> (PBV)	24
2.1.7 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) Terhadap <i>Return</i>	

Saham	25
2.1.8 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) Terhadap <i>Return Saham</i> ..	26
2.1.9 Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> (NPM) Terhadap <i>Return Saham</i> .	27
2.1.10 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> (PBV) Terhadap <i>Return Saham</i> .	28
2.2 Penelitian Terdahulu	29
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis	38
2.2 Perumusan Hipotesis	37

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Jenis dan Sumber Data.....	40
3.2 Populasi.....	41
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	43
3.4 Definisi Operasional Variabel	44
3.5 Teknik Analisis Data	46
3.5.1 Analisis Regresi Berganda.....	46
3.5.2 Pengujian Asumsi Klasik.....	47
3.5.2.1 Uji Normalitas.....	47
3.5.2.2 Uji Multikolinearitas.....	49
3.5.2.3 Uji Autokorelasi.....	50
3.5.2.4 Uji Heteroskedastisitas.....	51
3.5.3 Uji Kelayakan Model.....	52
3.5.3.1 Uji F.....	52
3.5.3.2 Analisis Koefisien Determinasi (R^2).....	53
3.5.4 Pengujian Hipotesis (Uji t).....	54

BAB IV ANALISIS DATA

4.1. Gambaran Umum dan Deskriptif Data Obyek Penelitian	56
4.1.1. Gambaran Umum Obyek Penelitian	56

4.1.2. Deskriptif Statistik Variabel Penelitian	66
4.2. Model Penelitian	68
4.2.1. Perhitungan Rasio-rasio Keuangan	68
4.2.2. Pengujian Asumsi Klasik	69
4.2.2.1. Uji Normalitas	69
4.2.2.2. Uji Multikolinearitas	75
4.2.2.3. Uji Autokorelasi	76
4.2.2.4. Uji Heteroskedastisitas	79
4.2.3. Uji Kelayakan Model	81
4.2.3.1. Uji F	81
4.2.3.2. Uji Koefisien Determinasi (R^2)	82
4.2.4. Hasil Analisis Regresi Berganda	84
4.2.5. Pengujian Hipotesis (Uji t)	85
4.2.5.1. Pengujian Hipotesis 1	86
4.2.5.2. Pengujian Hipotesis 2	87
4.2.5.3. Pengujian Hipotesis 3	88
4.2.5.4. Pengujian Hipotesis 4	89

BAB V KESIMPULAN DAN IMPLIKASI HASIL PENELITIAN

5.1. Kesimpulan	91
5.2. Implikasi Hasil Penelitian	93
5.2.1. Implikasi Kebijakan Manajerial	93
5.2.2. Implikasi Teoritis	95
5.3. Keterbatasan Penelitian	97
5.4. Agenda Penelitian Mendatang	97

Daftar Pustaka	98
-----------------------------	----

Lampiran	102
-----------------------	-----