DAFTAR ISI

Halaman

Halaman Judul..... i
Persetujuan Skripsi..... ii
Pengesahan Kelulusan Ujian..... iii
Pernyataan Orisinalitas Skripsi..... iv
Halaman Motto..... v
Abstract..... vi
Abstrak..... vii
Kata Pengantar..... viii
Daftar Tabel..... xv
Daftar Gambar..... xvi
Daftar Lampiran..... xvii
Bab I : Pendahuluan..... 1
1.1 Latar Belakang Masalah..... 1
1.2 Perumusan Masalah..... 10
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian..... 12
1.3.1 Tujuan Penelitian..... 12
1.3.2 Kegunaan Penelitian..... 12
1.4 Sistematika Penulisan..... 13
Bab II : Telaah Pustaka..... 15
2.1 Landasan Teori..... 15
2.1.1 Pasar Modal..... 15
2.1.2 Teori Investasi..... 18
2.1.3 Investasi Pasar Modal..... 19
2.1.4 Saham Sebagai Pilihan Investasi..... 21
2.1.5 Harga Saham..... 22
2.1.6 Konsep Return dalam Saham..... 23
2.1.7 Analisis Fundamental..... 25
2.1.8 Analisis Rasio Keuangan..... 26

2.1.9 Rasio Rentabilitas/Profitabilitas..... 28
2.1.9.1 Return On Asset (ROA)……..... 28
2.1.9.2 Net Profit Margin (NPM)……..... 29
2.1.10 Rasio Pasar (Market Ratio)…..... 30
2.1.10.1 Earning Per Share (EPS)……..... 31
2.1.10.2 Price Earning Ratio (PER)……..... 32
2.2 Penelitian Terdahulu..... 33
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis…..... 40
2.4 Hipotesis……..... 41
Bab III : Metode Penelitian..... 43
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional..... 43
3.2 Penentuan Sampel..... 46
3.3 Jenis dan Sumber Data..... 47
3.4 Metode Pengumpulan Data..... 47
3.5 Metode Penelitian……..... 47
3.5.1 Uji Asumsi Klasik……..... 48
3.5.2 Analisis Regresi Berganda..... 51
3.5.3 Uji Hipotesis..... 53
Bab IV: Hasil Analisis dan Pembahasan..... 56
4.1 Statistik Deskriptif..... 56
4.2 Analisis Data……..... 60
4.2.1 Screening Data..... 60
4.2.2 Uji Asumsi Klasik..... 62
4.2.2.1 Uji Normalitas……..... 63
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas……..... 65
4.2.2.3 Uji Autokorelas……..... 66
4.2.2.4 Uji Heteroskedastisitas……..... 68
4.2.3 Analisis Regresi Berganda..... 70
4.2.3.1 Uji Koefisien Determinasi (R2)……..... 70
4.2.3.2 Uji Simultan (Uji F)……..... 71
4.2.3.3 Uji Signifikasi Parameter Individual (T-test)..... 72

4.2.3.4 Persamaan Garis Regresi……..... 73
4.3 Pembahasan..... 76
4.3.1 Pengaruh ROA terhadap return saham..... 76
4.3.2 Pengaruh NPM terhadap return saham..... 77
4.3.3 Pengaruh EPS terhadap return saham…..... 78
4.3.4 Pengaruh PER terhadap return saham..... 80
Bab V: PENUTUP..... 82
5.1 Kesimpulan..... 82
5.2 Keterbatasan Penelitian..... 83
5.3 Agenda..... 84
5.4 Saran..... 84
Daftar Pustaka..... 86
Lampiran..... 87

UNIVERSITAS DIPONEGORO
SEMARANG
FEB UNDIP