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 *Pecking Order Theory* 13
2.1.4 Investasi di Pasar Modal 16
2.1.5 *Return* Saham 17
2.1.7 Komponen *Return* 19
2.1.8 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi
Pergerakan *Return Saham*..... 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 Return Saham..... 34
2.2.1.2 Pengaruh EPS terhadap Return Saham 35
2.2.1.3 Pengaruh Volume Perdagangan
terhadap Return Saham 35
2.3 Hipotesis..... 37
BAB III METODE PENELITIAN 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
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 54
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

UNIVERSITAS DIPONEGORO SEMARANG FEB UNDIP