

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Lembar Pengesahan Tesis	ii
Motto dan Persembahan	iii
Sertifikasi	iv
Abstraksi	v
Abstract	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar	ix
Daftar Rumus	x
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
BAB II. TELAAH PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN TEORITIS	7
2.1 Investasi	7
2.2 Saham	8
2.3 Return Saham	9
2.4 Analisis Fundamental	10

2.5	Variabel Independen	11
2.5.1	Return on Asset	11
2.5.2	Sales Growth	12
2.5.3	Volume Perdagangan	13
2.5.4	Price to Book Value	13
2.5.5	Earning per Share	14
2.6	Penelitian Terdahulu	15
2.7	Pengaruh Variabel-Variabel Yang Akan Diteliti Terhadap Return Saham	20
2.7.1	Pengaruh Return on Asset Terhadap Return Saham	20
2.7.2	Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Return Saham	21
2.7.3	Pengaruh Sales Growth Terhadap Return Saham	21
2.7.4	Pengaruh Price to Book Value Terhadap Return Saham	22
2.7.5	Pengaruh Earning per Share Terhadap Return Saham	23
2.9	Kerangka Pemikiran Teoritis	24

BAB III. METODE PENELITIAN	26
3.1 Jenis dan Sumber Data	26
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian	26
3.3 Metode Pengumpulan Data	27
3.4 Metode Analisis	29
3.4.1 Pengujian Asumsi Klasik	29
3.4.2 Uji Hipotesis	30
BAB IV. ANALISIS DATA	31
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	31
4.2 Deskriptif Statistik Variabel Penelitian	35
4.3 Uji Normalitas Data	37
4.4 Uji Multikolinearitas	39
4.5 Uji Autokorelasi	40
4.6 Uji Heteroskedastisitas	41
4.7 Hasil Analisis Regresi Berganda dan Pengujian Hipotesis	42
4.7.1 Uji Koefisien Determinasi (<i>Adjusted R²</i>)	45
4.7.2 Uji F	47
4.7.3 Uji Hipotesis	48
4.8 Pembahasan	50

**BAB V. SIMPULAN DAN IMPLIKASI
KEBIJAKAN**

		54
5.1	Simpulan	54
5.2	Implikasi Kebijakan	55
5.3	Keterbatasan Penelitian	57
5.4	Agenda Penelitian Mendatang	57
DAFTAR ISI		
LAMPIRAN		
DAFTAR RIWAYAT HIDUP		

FEB UNDIP