

## DAFTAR ISI

<b>JUDUL</b>	
<b>PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT</b> .....	i
<b>PERTANGGUNGJAWABAN SKRIPSI</b> .....	ii
<b>LEMBAR YURIDIS</b> .....	iii
<b>UCAPAN TERIMA KASIH</b> .....	iv
<b>ABSTRAK</b> .....	vi
<b>RINGKASAN SKRIPSI</b> .....	viii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	xiii
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	xvi
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xvii
<b>BAB I : PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	9
1.3 Tujuan Penelitian .....	10
1.4 Kegunaan Penelitian .....	11
<b>BAB II : TINJAUAN PUSTAKA</b>	
2.1. Landasan Teori .....	12
2.1.1 Pasar Modal .....	12
2.1.1.1 Pengertian Pasar Modal .....	12
2.1.2 Investasi .....	13
2.1.3 Saham .....	15
2.1.3.1 Pengertian Saham .....	15
2.1.3.2 Harga Saham .....	15
2.1.3.3 <i>Return</i> Saham .....	16
2.1.3.4 Risiko Saham .....	17
2.1.4 Laporan Keuangan .....	21
2.1.5 Analisis Fundamental .....	23
2.1.6 Rasio Sebagai Alat Ukur Kinerja Keuangan Perusahaan .....	24
2.1.6.1 Rasio Rentabilitas/Profitabilitas .....	24
2.1.6.2 Rasio <i>Financial Leverage</i> .....	25
2.1.6.3 Rasio <i>Aktivitas</i> .....	26
2.1.6.4 Rasio <i>Nilai Pasar</i> .....	28
2.1.6.5 Ukuran Perusahaan .....	29
2.2 Penelitian Terdahulu .....	31
2.3 Kerangka Pemikiran dan Hubungan Antar Variabel .....	35
2.3.1 Kerangka Pemikiran .....	35
2.3.2 Hubungan Antar Variabel .....	36
2.3.2.1 Pengaruh <i>Return On Asset (ROA)</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	36

2.3.2.2	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) Terhadap <i>Return Saham</i> .....	36
2.3.2.3	Pengaruh <i>Total Asset Turn Over</i> (TATO) Terhadap <i>Return Total Saham</i> .....	37
2.3.2.4	Pengaruh ( <i>Dividen Per Share</i> ) DPS Terhadap <i>Return Saham</i> .....	38
2.3.2.5	Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> .....	39

### **BAB III : JENIS PENELITIAN**

3.1	Jenis dan Sumber Data .....	40
3.2	Populasi dan Sampel .....	40
3.2.1	Populasi .....	40
3.2.2	Sampel .....	41
3.3	Metode Pengumpulan Data .....	43
3.4	Definisi Operasional Variabel.....	43
3.4.1	Variabel Dependen .....	43
3.4.1.1	<i>Return Saham</i> .....	43
3.4.2	Variabel Independen .....	44
3.4.2.1	<i>Return On Asset (ROA)</i> .....	44
3.4.2.2	<i>Debt To Equity (DER)</i> .....	44
3.4.2.3	<i>Total Asset Turnover (TATO)</i> .....	44
3.4.2.4	<i>Dividend Per Share (DPS)</i> .....	45
3.4.2.5	Ukuran Perusahaan .....	45
3.5	Pemilihan Data Panel dan Analisis Data Panel .....	45
3.5.1	Jenis-Jenis Model Regresi Pada Data Panel .....	45
3.5.2	Pemilihan Model Dalam Regresi Data Panel .....	47
3.5.3	Analisis Regresi Data Panel .....	48
3.5.3.1	Uji Asumsi Klasik .....	50
3.6	Pengujian Hipotesis .....	52
3.6.1	Uji Signifikansi Pengaruh Simultan (Uji F) .....	52
3.6.2	Uji Signifikansi Pengaruh Parsial (Uji t).....	53
3.6.3	Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	53

### **BAB IV : ANALISIS DAN PEMBAHASAN**

4.1	Hasil penelitian .....	55
4.1.1	Statistik Deskriptif.....	55
4.1.2	Pemilihan Model Linier Regresi Data Panel .....	57
4.1.3	Uji Asumsi Klasik .....	58
4.1.4	Analisis Regresi Data Panel .....	61
4.1.5	Pengujian Uji Statistik.....	62
4.1.5.1	Pengujian Uji T Statistik.....	62
4.1.5.2	Pengujian Uji F Statistik.....	64
4.1.5.3	Pengujian Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	65

4.2	Pembahasan .....	65
4.2.1	<i>Return On Asset</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	65
4.2.2	Debt to Equity Ratio Terhadap <i>Return Saham</i> .....	66
4.2.3	Total Asset Turnover Terhadap <i>Return Saham</i> .....	68
4.2.4	Dividend Per Share Terhadap <i>Return Saham</i> .....	68
4.2.5	<i>Size</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	70

## **BAB V : KESIMPULAN DAN SARAN**

5.1	Kesimpulan .....	71
5.1	Saran .....	72

## **DAFTAR PUSTAKA**

## **LAMPIRAN**