

## DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI .....	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI .....	iii
<i>ABSTRACT</i> .....	iv
ABSTRAK.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GRAFIK.....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
KATA PENGANTAR.....	xiv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang .....	1
B. Rumusan Masalah .....	9
C. Tujuan Penelitian .....	9
D. Kontribusi Penelitian .....	10
a. Kegunaan Teoritis .....	10
b. Kegunaan Praktis.....	10
BAB II.....	11
KAJIAN PUSTAKA DAN RERANGKA PEMIKIRAN.....	11
A. Kajian Teori .....	11
1. Investasi.....	11
2. Pasar Modal.....	13
3. Saham .....	14
4. Harga saham .....	18
5. Analisis Sekuritas .....	23
6. Analisis Laporan Keuangan .....	24
7. Rasio Keuangan.....	26
B. Penelitian yang Relevan.....	30

C. Kerangka Berpikir.....	35
D. Hipotesis Penelitian .....	35
BAB III .....	39
METODE PENELITIAN.....	39
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	39
B. Desain Penelitian .....	39
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	39
D. Populasi dan Sampel Penelitian .....	41
1. Populasi .....	41
2. Sampel Penelitian.....	41
E. Teknik Pengumpulan Data.....	42
F. Metode Analisis Data.....	43
1. Analisis Deskriptif.....	43
2. Analisis Kualitatif Data.....	43
3. Analisis Regresi Data Panel .....	44
4. Pemilihan Regresi Data Panel.....	46
5. Pengujian Model Regresi Data Panel.....	47
6. Pengujian Koefisien Regresi Data Panel.....	48
BAB IV .....	50
HASIL DAN PEMBAHASAN.....	50
A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	50
B. Analisis Statistik Deskriptif .....	50
a. Statistik Deskriptif Harga Saham .....	50
b. Statistik Deskriptif <i>Earning Per Share</i> .....	51
c. Statistik Deskriptif <i>Debt to Equity Ratio</i> .....	51
d. Statistik Deskriptif <i>Total Assets Turnover</i> .....	52
e. Statistik Deskriptif <i>Price Earnings Ratio</i> .....	52
C. Analisis Kualitatif Data.....	53
1. Uji Stasioner Harga Saham .....	53
2. Uji Stasioner <i>Earning Per Share</i> .....	54
3. Uji Stasioner <i>Debt to Equity Ratio</i> .....	54

4. Uji Stasioner <i>Total Assets Turnover</i> .....	55
5. Uji Stasioner <i>Price Earnings Ratio</i> .....	55
D. Analisis Regresi Data Panel.....	56
1. <i>Common Effect Model</i> .....	56
2. <i>Fixed Effect Model</i> .....	57
3. <i>Random Effect Model</i> .....	59
E. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	60
1. <i>Uji Chow Test</i> .....	60
2. <i>Uji Lagrange Multiplier</i> .....	62
F. Analisis Model Regresi Data Panel.....	63
1. Pengujian Model Regresi Data Panel (Uji R).....	63
2. Pengujian Model Regresi Data Panel (Uji F).....	63
3. Pengujian Model Regresi Data Panel (Uji <i>t-statistic</i> ).....	65
BAB V.....	71
KESIMPULAN DAN SARAN.....	71
A. Kesimpulan.....	71
B. Keterbatasan Penelitian.....	71
C. Saran.....	72
DAFTAR PUSTAKA.....	73
LAMPIRAN.....	76