

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
<i>ABSTRACT</i>	iii
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	6
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	7
1. Tujuan Penelitian.....	7
2. Kontribusi Penelitian	7
BAB II	9
KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	9
A. Kajian Pustaka	9
1. Manajemen Keuangan	9
2. Investasi	10
3. Pasar Modal	11
4. <i>Return</i> Saham.....	15

5.	Rasio Keuangan	18
6.	Ringkasan Kajian Riset Terdahulu.....	22
B.	Rerangka Pemikiran.....	25
C.	Hipotesis.....	26
BAB III	31
METODE PENELITIAN	31
A.	Waktu dan Tempat Penelitian.....	31
B.	Desain Penelitian	31
C.	Definisi dan Operasionalisasi Variabel	31
1.	Definisi Variabel Penelitian	31
2.	Definisi Operasional Variabel.....	34
D.	Populasi dan Sampel Penelitian.....	34
1.	Populasi Penelitian	34
2.	Sample Penelitian.....	35
E.	Teknik Pengumpulan Data	36
F.	Metode Analisis Data.....	36
1.	Analisis Deskriptif.....	37
2.	Analisis Kualitas Data	37
3.	Uji Asumsi Klasik	38
4.	Analisis Regresi Data Panel.....	42
5.	Uji Hipotesis	47
BAB IV	50
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	50
A.	Gambaran Objek Penelitian.....	50

1.	PT. Ratu Prabu Energi Tbk (ARTI)	50
2.	PT. Elnusa Tbk (ELSA).....	51
3.	PT. Radiant Utama Interinsco Tbk (RUIS)	51
4.	PT. Aneka Tambang (Persero) Tbk (ANTM).....	52
5.	PT. Cita Mineral Investindo Tbk (CITA).....	52
6.	PT. Timah (Persero) Tbk (TINS).....	53
7.	PT. Mitra Investindo Tbk (MITI).....	53
8.	PT. Perdana Karya Perkasa Tbk (PKPK)	54
9.	PT. Tambang Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk (PTBA).....	54
B.	Analisis Statistik Deskriptif.....	55
C.	Analisis Kualitas Data.....	58
1.	Uji Stasioneritas	58
D.	Hasil Uji Asumsi Klasik.....	63
1.	Uji Normalitas.....	63
2.	Uji Multikolinieritas	64
3.	Uji Heteroskedastisitas	64
4.	Uji Autokorelasi	65
E.	Analisis Regresi Data Panel	67
1.	<i>Common effect</i>	67
2.	<i>Fixed Effect</i>	68
3.	<i>Random Effect</i>	71
F.	Pemilihan Model Regresi Data Panel	72
1.	Uji <i>Chow-Test</i>	72
G.	Analisis Model Regresi Data Panel	73

H.	Hasil Kesesuaian Model Regresi Data Panel.....	76
1.	Analisis Koefisien Determinasi (R^2)	76
2.	Uji Statistik F	76
I.	Hasil Uji Hipotesis	77
J.	Pembahasan Hasil Penelitian	79
1.	Pengaruh <i>Current Ratio</i> (CR) terhadap <i>Return Saham</i>	79
2.	Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) terhadap <i>Return Saham</i>	80
3.	Pengaruh <i>Debt Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	81
4.	Pengaruh <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>Return Saham</i>	81
5.	Pengaruh <i>Price earning Ratio</i> (PER) terhadap <i>Return Saham</i>	82
BAB V	84
KESIMPULAN DAN SARAN	84
A.	Kesimpulan	84
B.	Saran	84
DAFTAR PUSTAKA	86
LAMPIRAN	88