

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
<b>HALAMAN JUDUL</b>	
<b>SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI</b>	<b>i</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI</b>	<b>ii</b>
<b>ABSTRAK</b>	<b>iii</b>
<b>ABSTRACT</b>	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I</b>	<b>PENDAHULUAN</b>
	A. Latar Belakang Penelitian 1
	B. Rumusan Masalah Penelitian 9
	C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian 10
	1. Tujuan Penelitian 10
	2. Kontribusi Penelitian 10
<b>BAB II</b>	<b>KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PENELITIAN DAN HIPOTESIS</b>
	A. Kajian Pustaka 12
	1. Pasar Modal 12
	2. Investasi 13
	3. Saham 14
	a. Pengertian Saham 14
	b. Jenis-Jenis Saham 14
	4. Laporan Keuangan 16
	5. <i>Return</i> Saham 17
	a. Pengertian <i>Return</i> Saham 17
	b. Jenis-Jenis <i>Return</i> Saham 18
	c. Komponen <i>Return</i> Saham 19
	d. Faktor Yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham 19
	6. <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) 22
	7. <i>Price Earning Ratio</i> (PER) 23
	8. Ukuran Perusahaan 24
	9. Penelitian Terdahulu 25
	B. Rerangka Pemikiran dan Pengembangan Hipotesis 30
<b>BAB III</b>	<b>METODE PENELITIAN</b>
	A. Waktu dan Tempat Penelitian 34
	B. Desain Penelitian 34

C. Definisi dan Operasional Variabel	34
1. Definisi Variabel	34
a. Variabel Dependen	34
b. Variabel Independen	35
2. Operasional Variabel	36
D. Populasi dan Sampel Penelitian	36
1. Populasi	36
2. Sampel	37
E. Teknik Pengumpulan Data	38
F. Metode Analisis Data	39
1. Analisis Deskriptif	39
2. Uji Stasioneritas Data	39
3. Analisis Regresi Data Panel	40
a. Common Effect Model	41
b. Fixed Effect Model	41
c. Random Effect Model	41
4. Pemilihan Model Regresi Data Panel	42
a. Uji Chow Test	42
b. Uji Hausman	42
c. Uji Langrage Multiplier	43
5. Uji Kelayakan Model	44
a. Koefisien Determinasi ( $R^2$ )	44
b. Uji Hipotesis	45
1) Uji F	45
2) Uji t	45

<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	
A. Gambaran Umum Perusahaan		47
B. Hasil Uji Statistik Deskriptif		53
C. Hasil Uji Stasioneritas Data		56
1. Uji Stasioneritas Return Saham		57
2. Uji Stasioneritas DER		58
3. Uji Stasioneritas PER		59
4. Uji Stasioneritas Ukuran Perusahaan		60
D. Hasil Uji Regresi Data Panel		61
1. Hasil Uji Metode Common Effect Model		61
2. Hasil Uji Metode Fixed Effect Model		63
3. Hasil Uji Metode Random Effect Model		64
E. Pemilihan Model Regresi Data Panel		65
1. Uji Chow Test		65
F. Hasil Uji Kelayakan Model		66
1. Koefisien Determinasi ( $R^2$ )		66
2. Hasil Uji Hipotesis		67
a. Secara Simultan (Uji F)		67
b. Secara Parsial (Uji t)		68
G. Pembahasan Hasil Penelitian		71

<b>BAB V</b>	<b>SIMPULAN DAN SARAN</b>	
	A. Simpulan	77
	B. Saran	78
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>		<b>79</b>
<b>LAMPIRAN</b>		<b>84</b>

