

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	8
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	9
1. Tujuan Penelitian	9
2. Kontribusi Penelitian	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	11
A. Kajian Pustaka	11
1. Pasar Modal	11
2. Investasi	11
a. Pengertian Investasi	11
b. Tujuan Investasi	12
3. Saham	13
a. Pengertian Saham	13
b. Jenis-Jenis Saham	13
4. <i>Return</i> Saham	14
a. Pengertian <i>Return</i> Saham.....	14
b. Jenis Saham.....	15
c. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	16

d. Faktor Mikro Ekonomi dan Makro Ekonomi	16
5. Struktur Modal.....	18
6. Kinerja Keuangan	19
B. Penelitian Terdahulu.....	22
C. Rerangka Pemikiran	27
D. Hipotesis.....	28
a. Pengaruh <i>Current ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	28
b. Pengaruh <i>Return on equity</i> (ROE) terhadap <i>Return Saham</i>	28
c. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	29
d. Pengaruh <i>Earning per Share</i> (EPS) terhadap <i>Return Saham</i>	29
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	30
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	30
B. Desain Penelitian	30
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	30
a. Variabel dependen sering juga disebut variabel terikat (Y).	31
b. Variabel Independen atau variabel bebas (X).....	31
D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	33
1. Populasi	33
2. Sampel	34
E. Teknik Pengumpulan Data.....	36
F. Teknik Analisis Data.....	37
G. Metode Analisis Data.....	37
1. Statistik Deskriptif.....	37
2. Uji <i>Stationeritas</i>	38
1. Analisis Regresi Data Panel.....	38
2. Uji Pemilihan Model	41
3. Uji Hipotesis	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
A. Gambaran Umum Objek Penelitian	45
1. PT Adaro Energy Tbk (ADRO)	45
2. PT Baramulti Suksesssarana Tbk (BSSR)	45

3. PT Harum Energy Tbk (HRUM)	46
4. PT Samindo Resources Tbk (MYOH)	46
5. PT Bukit Asam Tbk (PTBA).....	47
B. Hasil Penelitian	47
1. Statistik Deskriptif.....	47
C. Uji Stasioneritas	50
1. Uji Stasioneritas Data.....	50
D. Analisis Regresi Data Panel.....	53
2. Model <i>Common effect</i>	53
D. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	55
1. Uji Chow Pada Model <i>Fixed effect</i>	55
2. Uji Lagrange Multiplier Pada Uji <i>Common effect</i>	56
E. Uji Hipotesis	57
1. Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	58
2. Uji F Anova (Uji Statistik F).....	59
3. Hasil Uji Hipotesis (Uji Statistik t)	60
F. Pembahasan Hasil Penelitian	62
1. Pembahasan <i>Current ratio</i> dengan <i>Return Saham</i>	62
2. Pembahasan <i>Return on Equity</i> dengan <i>Return Saham</i>	63
3. Pembahasan <i>Debt to ratio</i> dengan <i>Return Saham</i>	64
4. Pembahasan <i>Earning per Share</i> dengan <i>Return Saham</i>	64
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	66
A. Kesimpulan	66
B. SARAN	66
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN.....	71