

DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAKSI	i
SURAT KETERANGAN RISET SKRIPSI	ii
SURAT TANDA PERSETUJUAN SKRIPSI	iii
SURAT PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT	iv
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Batasan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Penelitian Terdahulu	7
2.2 Kajian Teori	10
2.2.1 Investasi Saham	10
2.2.2 Saham	11
2.2.3 Tingkat Pengembalian	12
2.2.4 Model Indeks Tunggal (Single Indeks Model)	13
2.2.5 Resiko Sistematis	14
2.2.6 Beta	15
2.2.7 Faktor Fundamental	17
2.2.7.1 Return on Equity (ROE)	18
2.2.7.2 Debt to Equity Ratio (DER)	19

2.2.7.3	Price Earning Ratio (PER)	20
2.2.7.4	Earning Per Share (EPS)	21
2.2.7.5	Price Book Value (PBV)	21
2.3	Kerangka Berfikir	22
2.4	Hipotesis	23

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Jenis Penelitian	25
3.2	Variabel penelitian dan Definisi Operasional	25
3.3	Sumber Data	27
3.4	Populasi dan sampel	27
3.5	Metode pengumpulan data	28
3.6	Teknik Analisis Data	29
3.7	Uji Asumsi Klasik	30
3.7.1	Uji Normalitas	30
3.7.2	Uji Heteroskedastisitas	30
3.7.3	Uji Autokorelasi	31
3.7.4	Uji Multikolinearitas	32
3.7.5	Uji Linieritas	32
3.8	Uji Hipotesis	32
3.8.1	Uji Determinasi (R^2)	32
3.8.2	Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	33
3.8.3	Uji Signifikansi Individual (Uji Statistik t)	34

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Deskripsi Data Penelitian	36
4.2	Hasil Uji Asumsi Klasik	39
4.2.1	Uji Normalitas	39
4.2.2	Uji Heteroskedastisitas	41
4.2.3	Uji Autokorelasi	43
4.2.4	Uji Multikolinearitas	44
4.2.5	Uji Linieritas	45

4.3	Hasil Uji Hipotesis	45
4.3.1	Uji Determinasi (R ²)	45
4.3.2	Uji Serempak (Uji F)	46
4.3.3	Uji Parsial (Uji t)	47
4.4	Interpretasi Hasil Uji Hipotesis	48
4.4.1	Pengaruh beta terhadap return saham	48
4.4.2	Pengaruh ROE terhadap return saham	49
4.4.3	Pengaruh DER terhadap return saham	49
4.4.4	Pengaruh EPS terhadap return saham	49
4.4.5	Pengaruh PER terhadap return saham	49
4.4.6	Pengaruh PBV terhadap return saham	50
4.5	Pembahasan	50
4.4.1	Resiko Sistematis	50
4.4.2	Faktor Fundamental	51
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Simpulan	54
5.2	Saran	54
DAFTAR PUSTAKA		56
LAMPIRAN		58

