DAFTAR ISI

Halaman Judul ……..……i

Halaman Sampul Depan Skripsi……ii

Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme……iii

Halaman Pengesahan Skripsi……iv

Halaman Pengesahan Ujian Skripsi……v

HalamanPersembahan……....vi

Motto……vii

Abstrak……viii

Kata Pengantar……....x

Daftar Isi……..xiii

Daftar Tabel……..……..xvii

Daftar Gambar……..……..…xviii

Daftar Lampiran……..……....xix

BAB I PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang……1

1.2. Rumusan Masalah……..…….……7

1.3. Tujuan Penelitian……......7

1.4. Manfaat Penelitian……...8

BAB II KAJIAN PUSTAKA

2.1. Pasar Modal…….……9

2.1.1. Manfaat Pasar Modal ……..……...….10

2.2. Saham…….…12

2.2.1. Macam – Macam Saham……13

2.2.2. *Return* Saham ...……..16

2.3. Suku Bunga……..……...21

2.3.1. Suku Bunga Bank Indonesia……..…..…22

2.3.2. Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia……...……....22

2.4. Laporan Keuangan……...….23

2.5. Rasio Keuangan……25

2.5.1. *Debt to Equity Ratio* (DER)……...….26

2.5.2. *Return On Equity* (ROE)…….……...……..29

2.5.3. *Earning Per Share* (EPS)……..……..30

2.6. Penelitian Terdahulu…….……31

2.7. Pengembangan Hipotesis……..……...….34

2.7.1. Pengaruh Suku Bunga SBI Terhadap *Return* Saham……...……...34

2.7.2. Pengaruh DER Terhadap *Return* Saham…….…….…...…36

2.7.3. Pengaruh ROE Terhadap *Return* Saham……..……...…39

2.7.4. Pengaruh EPS Terhadap *Return* Saham……..…..….42

2.8. Kerangka Penelitian……..44

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1. Populasi dan Sampel Penelitian……...……..46

3.2. Data dan Sumber Data……....48

3.3. Definisi Operasional Variabel……...49

3.4. Metode Analisis Data…….51

3.4.1. Uji Asumsi Klasik……...51

3.4.2. Regresi Linear Berganda……..53

3.4.3. Koefisien Determinasi (R^2)……..54

3.4.4. Pengujian Hipotesis……..…55

BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN

4.1. Analisis Deskriptif……..……59

4.2. Uji Asumsi Klasik……..62

4.2.1. Uji Normalitas……..62

4.2.2. Uji Multikolinearitas……65

4.2.3. Uji Heterokesdasitas……67

4.2.4. Uji Autokorelasi……...68

4.3. Analisis Regresi Linear Berganda……..69

4.4. Koefisien Determinasi (R^2)……72

4.5. Pengujian Hipotesis……72

4.5.1. Uji Parsial (Uji t)……73

4.5.2. Uji Simultan (Uji F)……81

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1. Kesimpulan……83

5.2. Saran……...84

DAFTAR PUSTAKA……..……86

LAMPIRAN……..92

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Sampel Perusahaan……..…..47

Tabel 4.1 Analisis Deskriptif……..…..59

Tabel 4.2 Uji Normalitas……...65

Tabel 4.3 Uji Multikolinearitas…….....66

Tabel 4.4 Uji Autokorelasi……69

Tabel 4.5 Analisis Regresi Linear Berganda……...……..70

Tabel 4.6 Koefisien Determinasi……...72

Tabel 4.7 Uji Parsial (Uji t)…….……..74

Tabel 4.8 Uji Simultan (Uji F)……..82

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian……..….45

Gambar 4.1 Grafik Histogram (Uji Normalitas)……..….63

Gambar 4.2 Grafik Probability Plots (Uji Normalitas)…….64

Gambar 4.3 Grafik Scatterplot (Uji Heterokesdasitas)…….67

DAFTAR LAMPIRAN

1. Sampel Perusahaan……92
2. Data Perhitungan ROE Tahun 2013 – 2015……..93
3. Data Perhitungan DER Tahun 2013 – 2015……..96
4. Data Perhitungan EPS Tahun 2013 – 2015 ……..……99
5. Analisis Deskriptif……..……102
6. Uji Asumsi Klasik……...103
7. Uji Hipotesis……106