

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	v
ABSTRAKSI.....	vi
ABSTRACT.....	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penelitian	9

BAB II LANDASAN TEORI

A.	Pasar Modal	11
1.	Pengertian Pasar Modal	11
2.	Instrumen Pasar Modal	13
3.	Pasar Modal Indonesia	14
B.	Laporan Keuangan	17
C.	<i>Return On Assets</i>	19
D.	<i>Debt to Equity</i> (DER)	19
E.	<i>Price to Book Value</i> (PBV)	20
F.	Suku Bunga	21
G.	Inflasi	22
H.	<i>Return Saham</i>	26
I.	Hubungan ROA dengan <i>Return Saham</i>	28
J.	Hubungan DER dengan <i>Return Saham</i>	29
K.	Hubungan PBV dengan <i>Return Saham</i>	29
L.	Hubungan Suku Bunga dengan <i>Return Saham</i>	30
M.	Hubungan Inflasi dengan <i>Return Saham</i>	31
N.	Hubungan ROA, DER, PBV, Suku Bunga, dan Inflasi dengan <i>Return Saham</i>	32
O.	Penelitian Terdahulu	32

BAB III METODE PENELITIAN

A.	Pemilihan Objek Penelitian	35
----	----------------------------------	----

B.	Metode Penarikan Sampel	35
C.	Operasional Variabel	36
	1. <i>Return On Assets</i> (ROA)	36
	2. <i>Debt to Equity</i> (DER).....	37
	3. <i>Price to Book Value</i> (PBV)	37
	4. Suku Bunga	38
	5. Inflasi	39
	6. <i>Return Saham</i>	40
D.	Teknik Pengumpulan Data.....	41
E.	Teknik Analisis Data	41
	1. Statistik Deskriptif	42
	2. Normalitas	43
	3. Multikolinieritas	44
	4. Autokorelasi	44
	5. Heterokedastisitas	45
F.	Pengujian Hipotesis	45

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

A.	Hasil Pengumpulan Data Penelitian	47
B.	Statistik Deskriptif.....	47
C.	Hasil Analisis Data.....	49
	1. Uji Asumsi Klasik.....	49
	a. Uji Normalitas	50

b. Uji Multikolinieritas.....	51
c. Uji Autokorelasi.....	52
d. Uji Heterokedastisitas	52
2. Pengujian Hipotesis	53
D. Pembahasan Hasil Analisis	58

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan.....	63
B. Saran.....	64

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 *Signal Inflation* 4

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	32
Tabel 4.1 Sampel Penelitian Periode 2008-2011	47
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif.....	48
Tabel 4.3 Uji Normalitas	50
Tabel 4.4 Uji Multikolonieritas	51
Tabel 4.5 Uji Autokorelasi	52
Tabel 4.6 Uji Heterokedastisitas.....	52
Tabel 4.7 Hasil Ringkasan Analisis Regresi Berganda	53

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Output SPSS Pengujian Statistik Deskriptif
Lampiran 2	Output SPSS Pengujian Normalitas Sebelum Tranformasi
Lampiran 3	Output SPSS Pengujian Normalitas Sesudah Tranformasi
Lampiran 4	Output SPSS Pengujian Multikolonieritas
Lampiran 5	Output SPSS Pengujian Autokorelasi
Lampiran 6	Output SPSS Pengujian Heteroskedastisitas
Lampiran 7	Output SPSS Uji T Dan Output SPSS Uji F
Lampiran 8	Sampel Perusahaan Perbankan