

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Persetujuan Pembimbing.....	ii
Halaman Pengesahan.....	iii
Halaman Moto dan Persembahan	iv
Pernyataan Keaslian Karya Tulis Skripsi	v
Pernyataan Persetujuan Unggah Karya Tulis Skripsi	vi
Abstraksi	vii
<i>Abstract</i>.....	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar Isi	xi
Daftar Tabel.....	xiv
Daftar Gambar	xv
Daftar Lampiran	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian.....	8
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	9

BAB II LANDASAN TEORI	11
A. <i>Return</i> Saham	11
1. Definisi <i>Return</i> Saham	11
2. Jenis-jenis <i>Return</i> Saham	11
B. Faktor- faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham.....	12
C. <i>Earning Per Share</i> (EPS)	13
D. <i>Dividend Payout Ratio</i> (DPR).....	14
E. <i>Signalling Theory</i> (Teori Sinyal).....	15
F. <i>Arbitrage Pricing Theory</i> (APT).....	16
G. Penelitian Terdahulu.....	17
H. Hipotesis dan Pengembangan Hipotesis.....	20
I. Kerangka Pemikiran	23
BAB III METODE PENELITIAN	24
A. Jenis Penelitian	24
B. Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel	24
C. Jenis Data Penelitian dan Sumber Data Penelitian.....	25
D. Metode Pengumpulan Data	26
E. Definisi dan Pengukuran Variabel	26
F. Teknik Analisis Data	28
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	33
A. Hasil Pengumpulan Data	33
B. Statistik Deskriptif.....	34

C. Hasil Uji Asumsi Klasik	36
1. Uji Normalitas Residual	36
2. Hasil Uji Hipotesis	39
D. Pembahasan	41
E. Implikasi	43
BAB V PENUTUP	45
A. Simpulan.....	45
B. Keterbatasan	46
C. Saran.....	47

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Data EPS, DPR, dan Indeks Sektoral Manufaktur periode 2011-2014	3
Tabel 2.1 Penelitian terdahulu.....	19
Tabel 3.1 Definisi Operasional Variabel Penelitian dan Sumber Data Penelitian.....	27
Tabel 4.1 Penentuan Sampel Penelitian	33
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif	34
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Residual Awal.....	36
Tabel 4.4 Pengujian Normalitas Residual Setelah Transform Menggunakan Logaritma 10.....	37
Tabel 4.5 Pengujian Normalitas Residual Setelah <i>Outlier</i>	38
Tabel 4.6 Pengujian Normalitas Residual Setelah <i>Winsorizing</i>	38
Tabel 4.7 Hasil Analisis Regresi Berganda menggunakan <i>Bootstrapping</i>	40

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Perkembangan Tingkat Suku Bunga periode 2011-2014.....	5
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	23

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama Perusahaan Yang Menjadi Sampel Penelitian
- Lampiran 2 Data EPS, DPR, SBI, dan *Return* Saham
- Lampiran 3 Statistik Deskriptif
- Lampiran 4 Hasil Uji Normalitas Residual Awal
- Lampiran 5 Pengujian Normalitas Residual Setelah *Transform* Menggunakan Logaritma10
- Lampiran 6 Pengujian Normalitas Residual Setelah *Outlier*
- Lampiran 7 Pengujian Normalitas Residual Setelah *Winsorizing*
- Lampiran 8 Hasil Analisis Regresi Menggunakan *Bootstrapping*
- Lampiran 9 Hasil Analisis Regresi Berganda
- Lampiran 10 Kartu Bimbingan Skripsi