

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN SAMPUL</b> .....	<b>i</b>
<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS</b> .....	<b>iv</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN</b> .....	<b>v</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>vi</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>viii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1    Gambaran Umum Objek Penelitian .....	<b>1</b>
1.2    Latar Belakang Penelitian .....	<b>2</b>
1.3    Rumusan Masalah .....	<b>11</b>
1.4    Pertanyaan Penelitian .....	<b>11</b>
1.5    Tujuan Penelitian .....	<b>12</b>
1.6    Manfaat Penelitian .....	<b>13</b>
1.6.1 Aspek Teoritis .....	<b>13</b>
1.6.2 Aspek Praktis .....	<b>13</b>
1.7    Ruang Lingkup Penelitian.....	<b>13</b>
1.7.1 Lokasi dan Objek Penelitian .....	<b>13</b>
1.7.2 Waktu dan Periode Penelitian .....	<b>14</b>
1.8    Sistem Penulisan Tugas Akhir .....	<b>14</b>
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b> .....	<b>17</b>
2. 1    Teori-Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu .....	<b>17</b>
2. 1.1 Grand Theory (Signalling Theory).....	<b>17</b>

2. 1.2	Investasi .....	17
2. 1.3	Pasar Modal.....	18
2. 1.4	Saham.....	19
2.1.5	<i>Return Saham</i> .....	21
2.1.6	Inflasi .....	22
2.1.7	Tingkat Suku Bunga.....	23
2.1.8	<i>Return on Asset (ROA)</i> .....	25
2.2	Penelitian Terdahulu .....	<b>28</b>
2.3	Kerangka Pemikiran.....	<b>37</b>
2.3.1	Pengaruh Inflasi Terhadap <i>Return Saham</i> .....	38
2. 3.2	Pengaruh Tingkat Suku Bunga Terhadap <i>Return Saham</i> .....	38
2. 3.3	Pengaruh <i>Return on Asset (ROA)</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	39
2. 4	Hipotesis Penelitian.....	<b>40</b>
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>		<b>41</b>
3. 1	Karakteristik Penelitian.....	<b>41</b>
3. 2	Alat Pengumpulan Data .....	<b>42</b>
3.2.1	Variabel Independen .....	42
3.2.2	Variabel Dependen.....	43
3. 3	Tahapan Penelitian .....	<b>46</b>
3. 4	Populasi dan Sampel .....	<b>48</b>
3.4.1	Populasi .....	48
3.4.2	Sampel .....	48
3. 5	Pengumpulan Data dan Sumber Data .....	<b>49</b>
3.5.1	Pengumpulan Data .....	49
3.5.2	Sumber Data.....	49
3. 6	Teknis Analisis Data dan Pengujian Hipotesis .....	<b>50</b>
3.6.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	50
3.6.2	Uji Asumsi Klasik .....	50
3.6.3	Analisis Regresi Data Panel .....	52
3. 7	Pengujian Hipotesis.....	<b>54</b>

<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>59</b>
4. 1 Statistik Deskriptif .....	<b>59</b>
4. 1.1 Inflasi.....	61
4. 1.2 Tingkat Suku Bunga.....	61
4. 1.3 Return on Aset (ROA) .....	62
4. 1.4 Return Saham .....	64
4. 2 Uji Asumsi Klasik.....	<b>65</b>
4. 2.1 Uji Multikolinearitas .....	65
4. 2.2 Uji Heterokedastisitas .....	66
4. 3 Analisis Data Panel .....	<b>67</b>
4. 3.1 Pemilihan Model Data Panel.....	67
4. 3.2 Regresi Data Panel .....	70
4. 4 Pengujian Hipotesis.....	<b>72</b>
4. 4.1 Uji Simultan (Uji F) .....	72
4. 4.2 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	73
4. 4.3 Uji Parsial (Uji t) .....	74
4. 5 Analisis dan Pembahasan.....	<b>76</b>
4. 5.1 Pengaruh Inflasi terhadap <i>Return Saham</i> .....	76
4. 5.2 Pengaruh Tingkat Suku Bunga terhadap <i>Return Saham</i> .....	77
4. 5.3 Pengaruh <i>Return on Aset (ROA)</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	78
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>81</b>
5. 1 Kesimpulan .....	<b>81</b>
5. 2 Saran.....	<b>82</b>
5. 2.1 Aspek Teoritis .....	82
5. 2.2 Aspek Praktis .....	82
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>85</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>91</b>