

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar belakang Masalah.....	4
1.3 Perumusan Masalah	14
1.4 Tujuan Penelitian.....	16
1.5 Manfaat Penelitian.....	16
1.6 Sistematika Penulisan.....	17
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN RUANG LINGKUP PENELITIAN.....	19
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	19
2.1.1 Saham.....	19
2.1.1.1 Pengertian Saham.....	19
2.1.1.2 Jenis-Jenis Saham	19
2.1.1.3 <i>Return</i> Saham	21
2.1.2 Inflasi	22

2.1.3 BI Rate	23
2.1.4 Nilai Tukar Rupiah.....	24
2.1.5 Ratio Profitabilitas	25
2.1.5.1 <i>Earning per Shares</i> (EPS).....	25
2.1.5.1 <i>Return on Assets</i> (ROA).....	26
2.1.6.1 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER)	27
2.2 Penelitian Terdahulu	27
2.3 Kerangka Pemikiran.....	37
2.4 Hipotesis Penelitian.....	38
BAB III METODE PENELITIAN	39
3.1 Karakteristik Penelitian.....	39
3.2 Variabel Operasional.....	40
3.2.1 Variabel.....	40
3.2.1.1 Variabel Independen	40
3.2.1.2 Variabel Dependen.....	40
3.3 Tahapan Penelitian	43
3.4 Populasi dan Sampel	45
3.4.1 Populasi.....	45
3.4.2 Sampel.....	45
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	46
3.5.1 Jenis Data	46
3.5.2 Sumber Data.....	46
3.6 Teknik Analisis Data.....	46
3.6.1 Statistik Deskriptif	48
3.6.2 Model Regresi Data Panel.....	48
3.6.2.1 Uji Chow	50

3.6.2.2 Uji Hausmann	50
3.6.2.2 Uji Lagrange Multiplier	51
3.7 Pengujian Hipotesis.....	51
3.7.1 Uji Hipotesis Secara Simultan (Uji F)	51
3.7.2 Uji Hipotesis Secara Parsial (Uji t).....	51
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	54
4.1 Karakteristik Sampel.....	54
4.2 Hasil Penelitian	54
4.2.1 Deskripsi Varibel-variabel Penelitian	54
4.2.2 Pengujian Model	64
4.2.3 Pengujian Regresi Data Panel	66
4.2.3 Uji F	68
4.2.5 Uji t	69
4.2.6 Koefisien Determinasi.....	71
4.3 Pembahasan.....	71
4.3.1 Pengaruh Inflasi, BI Rate, Nilai Tukar, <i>Earning per Share</i> (EPS), <i>Return on Assets</i> (ROA), <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	71
4.3.2 Pengaruh Inflasi terhadap <i>return</i> saham	71
4.3.3 Pengaruh BI Rate terhadap <i>Return Saham</i>	72
4.3.4 Pengaruh Nilai Tukar terhadap <i>Return Saham</i>	72
4.3.5 Pengaruh <i>Earning per Share</i> (EPS) terhadap <i>Return Saham</i>	72
4.3.6 Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i> \.....	72
4.3.7 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	73
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	74
5.1 Kesimpulan.....	74
DAFTAR PUSTAKA	76

LAMPIRAN.....	79
---------------	----