

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	
PERNYATAAN DAN PERSETUJUAN UNGGAH TUGAS AKHIR	
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR	
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR	
ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR TABEL	viii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Batasan Masalah	6
1.6 Sistematika Pembahasan	6
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Teori Signal	8
2.2 Faktor Fundamental Perusahaan	9
2.2.1 <i>Debt Equity Ratio (DER)</i>	10
2.2.2 <i>Earning Per Shares (EPS)</i>	10
2.2.3 <i>Net Assets Values Per Shares (NAVPS)</i>	11
2.3 Faktor Makro Ekonomi	12
2.3.1 <i>Gross Domestic Product (GDP)</i>	12
2.3.2 <i>Interest Rates</i>	13
2.3.3 Indeks Harga Konsumen	14
2.4 <i>Return Saham</i>	14
2.5 Penelitian Terdahulu	15
2.6 Kerangka Pemikiran	20
2.7 Pengembangan Hipotesis	21
2.7.1 Pengaruh Fundamental Faktor Terhadap <i>Return Saham</i>	21
2.7.1.1 Pengaruh <i>Debt Equity Ratio (DER)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	21
2.7.1.2 Pengaruh <i>Earning Per Shares (EPS)</i> terhadap <i>Return Saham</i>	22
2.7.1.3 Pengaruh <i>Net Assets Value Per Shares (NAVPS)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	22
2.7.2 Pengaruh Makro Ekonomi Terhadap <i>Return Saham</i>	23
2.7.2.1 Pengaruh <i>Gross Domestic Product (GDP)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	23
2.7.2.2 Pengaruh <i>Interest Rate</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	24
2.7.2.3 Pengaruh Indeks Harga Konsumen Terhadap <i>Return Saham</i>	24
BAB III METODE PENELITIAN	26

3.1	Populasi dan Sampel	26
3.2	Teknik Pengumpulan Data	26
3.3	Model Empiris Penelitian.....	27
3.4	Definisi Variabel Operasional	27
3.4.1	Variabel Independen	28
3.4.2	Variabel Dependen.....	30
3.5	Metode Analisis Data	31
3.5.1	Analisis Deskriptif	31
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	31
3.5.2.1	Uji Normalitas.....	31
3.5.2.2	Uji Multikolinearitas	32
3.5.2.3	Uji Heteroskedastisitas	32
3.5.2.4	Analisis Auto Korelasi.....	32
3.5.3	Uji Hipotesis	33
3.5.3.1	Uji Koefisien Determinasi R^2	33
3.5.3.2	Uji Statistik F.....	33
3.5.3.3	Uji Statistik T	34
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	35
4.1	Deskriptif Statistik	35
4.2	Uji Asumsi Klasik.....	36
4.2.1	Uji Normalitas	36
4.2.2	Uji Auto Korelasi.....	37
4.2.3	Uji Multikolinearitas	38
4.2.4	Uji Heteroskedastisitas.....	38
4.3	Analisis Regresi	39
4.4	Pembahasan	40
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	44
5.1	Kesimpulan.....	44
5.2	Saran.....	44
DAFTAR PUSTAKA	46

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1: Jumlah Investor Pasar Modal.....	1
Gambar 2.1: Kerangka Pemikiran	21
Gambar 4.1: Sebaran Data	37



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1: Penelitian Sebelumnya	15
Tabel 3.1 Kriteria dan Jumlah Sampel.....	26
Tabel 4.1: Analisis Deskriptif	35
Tabel 4.2: Uji Normalitas SWILK, SFRANCIA dan SKTEST.....	36
Tabel 4.3: Uji Auto Korelasi.....	37
Tabel 4.4: Hasil Uji Multikolinieritas.....	38
Tabel 4.5: Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	38
Tabel 4.6: Hasil Analisis Regresi <i>Fix Effect Model</i>	39

