

## DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Pengesahan	
Lembar Pernyataan	
Prakata	
Abstrak	
Abstract	
Daftar Isi	
Daftar Tabel	
Daftar Gambar	
Daftar Lampiran	
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Penelitian .....	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	10
1.3 Batasan Masalah .....	11
1.4 Rumusan Masalah.....	11
1.5 Tujuan Penelitian.....	12
1.6 Manfaat Penelitian.....	12
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b>	
2.1 Kajian Literatur .....	14
2.1.1 Investasi dan saham.....	14
2.1.2 Penilaian dan Klasifikasi Saham.....	24
2.1.3 <i>Return</i> Saham.....	30
2.1.4 Analisa Rasio .....	32
2.1.5 Sertifikat Bank Indonesia.....	40
2.1.6 Pengertian mengenai nilai tukar Rupiah terhadap US\$ .....	42
2.1.7 Pengertian mengenai saham LQ 45.....	43

2.1.8 Pengaruh perubahan <i>Earning Per Share</i> terhadap <i>return</i> saham perusahaan.....	44
2.1.9 Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>return</i> saham perusahaan.....	45
2.1.10 Pengaruh perubahan SBI terhadap <i>return</i> saham perusahaan.....	45
2.1.11 Pengaruh perubahan nilai tukar Rupiah dengan US\$ terhadap <i>return</i> saham perusahaan.....	46
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu yang Relevan .....	47

### BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Kerangka Penelitian.....	50
3.2 Hipotesis Penelitian .....	54
3.3 Desain Penelitian .....	54
3.4 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	54
3.5 Teknik Pengumpulan Data dan Pengambilan Sampel.....	55
3.5.1 Jenis Data .....	55
3.5.2 Sumber Data .....	56
3.5.3 Teknik Pengumpulan Data.....	56
3.5.4 Waktu Penelitian.....	57
3.6 Uji Kualitas Data .....	57
3.6.1 Populasi.....	57
3.6.2 Sampel .....	57
3.7 Metode Analisis.....	58
3.7.1 Uji Asumsi Dasar Klasik .....	58
3.7.2 Analisis Regresi Berganda.....	62
3.7.3 Uji t.....	63
3.7.4 Uji F.....	63
3.7.5 <i>Standardized Coefficient Beta</i> .....	64

## BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Keadaan Umum Obyek Penelitian .....	65
4.1.1 Bursa Efek .....	65
4.1.2 Struktur Pasar Modal Indonesia .....	66
4.2 Pembahasan .....	68
4.2.1 Analisis Deskriptif .....	68
4.2.2 Uji Asumsi Dasar Klasik .....	69
4.2.2.1 Uji Normalitas Data .....	69
4.2.2.2 Uji Multikolinearitas .....	70
4.2.2.3 Uji Autokorelasi .....	72
4.2.2.4 Uji Gejala Heteroskedastisitas .....	73
4.2.3 Pengujian Regresi Linier Berganda .....	74
4.2.4 Pembahasan Hasil Penelitian .....	75
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan .....	78
5.2 Saran-saran .....	79
DAFTAR PUSTAKA .....	80
LAMPIRAN .....	82