

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I : PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Identifikasi dan Pembatasan Masalah	9
1. Identifikasi Masalah	9
2. Pembatasan Masalah	12
C. Rumusan Masalah	12
D. Tujuan dan Manfaat Penelitian	13
1. Tujuan Penelitian	13
2. Manfaat Penelitian	14
E. Sistematika Penulisan	14
BAB II: TINJAUAN PUSTAKA	16
A. Landasan Teori	16
1. Efficient Market Theory.....	16

2. Pengertian dan Fungsi Pasar Modal.....	21
3. Investasi dalam Saham.....	23
4. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	30
5. Return Saham.....	37
6. Return Pasar.....	40
7. Earning Per Share.....	44
8. Debt Equity Ratio.....	46
9. Penelitian Terdahulu.....	49
B. Kerangka Pikir Penelitian.....	56
C. Hipotesis.....	57
BAB III: METODOLOGI PENELITIAN.....	58
A. Tempat dan Waktu Penelitian.....	58
1. Tempat Penelitian.....	58
2. Waktu Penelitian.....	58
B. Jenis dan Sumber Data.....	58
C. Populasi dan Sampel Penelitian.....	59
1. Populasi Penelitian.....	59
2. Sampel Penelitian.....	59
D. Identifikasi dan Definisi Operasional Variabel.....	60
1. Identifikasi Variabel.....	60
2. Definisi Operasional.....	61
E. Metode Pengumpulan Data.....	62
F. Metode Analisa Data.....	63

1. Analisis Statistik Deskriptif	63
2. Koefisien Determinasi	63
3. Regresi Linear Berganda.....	63
4. Uji Kualitas Data.....	64
a. Uji Normalitas	64
b. Uji Asumsi Klasik.....	65
1. Uji Multikolinearitas.....	65
2. Uji Autokorelasi	66
3. Uji Heterokedastisitas	66
5. Uji Hipotesis.....	67
a. Uji Simultan (F-test)	67
b. Uji Parsial (t- test).....	67
BAB IV GAMBARAN UMUM LOKASI PENELITIAN	70
A. Sejarah Bursa Efek Indonesia	70
B. Sejarah Perusahaan Makanan dan Minuman yang Menjadi Sampel	73
BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	85
A. Hasil Penelitian	85
1. Pengaruh Earning Per Share, Debt Equity Ratio, Return Pasar terhadap return saham perusahaan.....	85
2. Data Deskriptif Variabel Penelitian.....	88
3. Statistik Deskriptif Variabel	96
4. Uji Normalitas.....	98

5. Uji Asumsi Klasik.....	100
6. Analisis Ordinary Least Square dan Uji Hipotesis	105
7. Koefisien Determinasi (R^2).....	110
B. Pembahasan	111
1. Pengaruh Earning Per Share Terhadap Return Saham	111
2. Pengaruh DER Terhadap Return Saham.....	112
3. Pengaruh Return Pasar Terhadap Return Saham	114
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN	116
A. Kesimpulan	116
B. Saran.....	116

DAFTAR PUSTAKA