

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAKSI	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang.....	1
B. Identifikasi dan Pembatasan Masalah.....	5
C. Perumusan Masalah.....	6
D. Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	7
E. Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Saham	10
1. Definisi Saham	10

2. Faktor-faktor yang Mempengaruhi saham	14
3. Faktor-faktor yang Menentukan Nilai Saham	16
B. Definisi LQ-45	17
C. Faktor Fundamental Keuangan Perusahaan	18
1. ROA.....	19
2. ROE	20
3. DER	22
4. PER	23
5. Required rate of Return	25
6. EPS	26
7. Book Value	26
D. RESIKO SISTEMATIS.....	27
E. PRICE BOOK VALUE	30
F. HUBUNGAN ANTARA VARIABEL X1, X2 DENGAN VARIABEL Y	32
1. Hubungan Faktor Fundamental dengan Price Book Value	32
2. Hubungan Resiko Sistematis (Beta Saham) dengan Price Book Value	33
G. PENELITIAN TERDAHULU	34
H. KERANGKA PENELITIAN	38
I. HIPOTESIS PENELITIAN	39

BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	40
	A. TEMPAT DAN WAKTU PENELITIAN	40
	B. POPULASI DAN SAMPEL	40
	C. JENIS DAN SUMBER DATA	42
	D. TEKNIK PENGUMPULAN DATA	43
	E. METODE DAN ANALISA DATA	43
	F. OPERASIONAL VARIABEL PENELITIAN	50
BAB IV	GAMBARAN UMUM OBJEK PENELITIAN	55
	A. PT. Perusahaan Gas Negara Tbk	55
	B. PT. Aneka Tambang Tbk	55
	C. PT. International Nickel Indonesia Tbk	56
	D. PT. Medco Energi International Tbk	57
	E. PT. Indah Kiat Pulp and Paper Tbk	58
	F. PT. Indofood Sukses Makmur Tbk	59
	G. PT. Tambang Batu Bara bukit Asam Tbk	60
	H. PT. Telkom Indonesia Tbk	60
	I. PT. United Tractor Tbk	61
	J. PT. Astra Agro Lestari Tbk	63
	K. PT. Astra Internasional Tbk	63
	L. PT. Indosat Tbk	64
	M. PT. Holcim Indonesia Tbk	65

N. PT. Bakrie Sumatera Plantations Tbk	66
BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	68
A. Statistik Deskriptif	68
B. Uji Asumsi klasik	69
1. Uji Normalitas	69
2. Uji Multikolinearitas	70
3. Uji Heterokedastisitas	72
4. Uji Autokorelasi	73
C. Analisis Regresi	75
D. Uji Hipotesis	78
1. Uji t	78
2. Uji f	83
BAB VI SARAN DAN KESIMPULAN	86
A. Kesimpulan	86
B. Saran	87
DAFTAR PUSTAKA	89

DAFTAR TABEL

No.	Nama Tabel	Halaman
1.1	PER,DER,BV Dan PBV 14 Perusahaan yang ber- Tahan di posisi LQ – 45 periode 2009	4
3.1	Sampel Penelitian	42
5.1	Statistik Deskriptif	68
5.2	Hasil Uji Multikolinearitas	71
5.3	Hasil Uji Autokorelasi	74
5.4	Hasil Perhitungan Nilai Regresi	76
5.5	Hasil Uji t	78
5.6	Hasil Uji f	83

DAFTAR GAMBAR

No.	Daftar Gambar	Halaman
1.1	Grafik Perdagangan Saham LQ – 45 tahun 2009	2
2.1	Kerangka Pikir Penelitian	38
5.1	Normal P-P Plot of Regression	70
5.2	Hasil Uji Heterokedastisitas	73

DAFTAR LAMPIRAN

No.	Nama Tabel	Halaman
1	Rekapitulasi Data PER	91
2	Rekapitulasi Data DER	94
3	Perhitungan Pengembalian Pasar dan Saham	97
4	Perhitungan Beta Saham	123
5	Perhitungan PBV	126
6	Perhitungan Required rate of return	128
7.	Hasil Perhitungan PER,DER,R,BETA, dan PBV	131
8.	Hasil Perhitungan SPSS	134