

## DAFTAR ISI

|   |       |
|---|-------|
| Halaman Judul .....                       | i     |
| Halaman Sampul Depan Skripsi.....         | ii    |
| Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme..... | iii   |
| Halaman Pengesahan Skripsi.....           | iv    |
| Halaman Pengesahan Ujian Skripsi.....     | v     |
| HalamanPersembahan.....                   | vi    |
| Motto.....                                | vii   |
| Abstrak.....                              | viii  |
| Kata Pengantar.....                       | x     |
| Daftar Isi.....                           | xiii  |
| Daftar Tabel.....                         | xvii  |
| Daftar Gambar.....                        | xviii |
| Daftar Lampiran.....                      | xix   |
| <br>BAB I PENDAHULUAN                     |       |
| 1.1. Latar Belakang.....                  | 1     |
| 1.2. Rumusan Masalah.....                 | 7     |

|                              |   |
|------------------------------|---|
| 1.3. Tujuan Penelitian.....  | 7 |
| 1.4. Manfaat Penelitian..... | 8 |

## BAB II KAJIAN PUSTAKA

|  |    |
|--|----|
| 2.1. Pasar Modal.....  | 9  |
| 2.1.1. Manfaat Pasar Modal.....                                  | 10 |
| 2.2. Saham.....  | 12 |
| 2.2.1. Macam – Macam Saham.....                                  | 13 |
| 2.2.2. <i>Return</i> Saham.....                                  | 16 |
| 2.3. Suku Bunga.....   | 21 |
| 2.3.1. Suku Bunga Bank Indonesia.....                            | 22 |
| 2.3.2. Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia.....                 | 22 |
| 2.4. Laporan Keuangan.....                                       | 23 |
| 2.5. Rasio Keuangan.....   | 25 |
| 2.5.1. <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....                    | 26 |
| 2.5.2. <i>Return On Equity</i> (ROE).....                        | 29 |
| 2.5.3. <i>Earning Per Share</i> (EPS).....                       | 30 |
| 2.6. Penelitian Terdahulu.....                                   | 31 |
| 2.7. Pengembangan Hipotesis.....                                 | 34 |
| 2.7.1. Pengaruh Suku Bunga SBI Terhadap <i>Return</i> Saham..... | 34 |
| 2.7.2. Pengaruh DER Terhadap <i>Return</i> Saham.....            | 36 |
| 2.7.3. Pengaruh ROE Terhadap <i>Return</i> Saham.....            | 39 |

|   |    |
|---|----|
| 2.7.4. Pengaruh EPS Terhadap <i>Return</i> Saham..... | 42 |
| 2.8. Kerangka Penelitian.....                         | 44 |

### BAB III METODOLOGI PENELITIAN

|   |    |
|---|----|
| 3.1. Populasi dan Sampel Penelitian.....    | 46 |
| 3.2. Data dan Sumber Data.....              | 48 |
| 3.3. Definisi Operasional Variabel.....     | 49 |
| 3.4. Metode Analisis Data.....              | 51 |
| 3.4.1. Uji Asumsi Klasik.....               | 51 |
| 3.4.2. Regresi Linear Berganda.....         | 53 |
| 3.4.3. Koefisien Determinasi ( $R^2$ )..... | 54 |
| 3.4.4. Pengujian Hipotesis.....             | 55 |

### BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN

|                                   |    |
|-----------------------------------|----|
| 4.1. Analisis Deskriptif.....     | 59 |
| 4.2. Uji Asumsi Klasik.....       | 62 |
| 4.2.1. Uji Normalitas.....        | 62 |
| 4.2.2. Uji Multikolinearitas..... | 65 |
| 4.2.3. Uji Heterokedstasitas..... | 67 |

|  |           |
|--|-----------|
| 4.2.4. Uji Autokorelasi.....               | 68        |
| 4.3. Analisis Regresi Linear Berganda..... | 69        |
| 4.4. Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....  | 72        |
| 4.5. Pengujian Hipotesis.....              | 72        |
| 4.5.1. Uji Parsial (Uji t).....            | 73        |
| 4.5.2. Uji Simultan (Uji F).....           | 81        |
| <b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>          |           |
| 5.1. Kesimpulan.....                       | 83        |
| 5.2. Saran.....                            | 84        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>                 | <b>86</b> |
| <b>LAMPIRAN.....</b>                       | <b>92</b> |

## DAFTAR TABEL

|   |    |
|---|----|
| Tabel 3.1 Sampel Perusahaan.....                | 47 |
| Tabel 4.1 Analisis Deskriptif.....              | 59 |
| Tabel 4.2 Uji Normalitas.....                   | 65 |
| Tabel 4.3 Uji Multikolinearitas.....            | 66 |
| Tabel 4.4 Uji Autokorelasi.....                 | 69 |
| Tabel 4.5 Analisis Regresi Linear Berganda..... | 70 |
| Tabel 4.6 Koefisien Determinasi.....            | 72 |
| Tabel 4.7 Uji Parsial (Uji t).....              | 74 |
| Tabel 4.8 Uji Simultan (Uji F).....             | 82 |

## DAFTAR GAMBAR

|   |    |
|---|----|
| Gambar 2.1 Kerangka Penelitian.....                       | 45 |
| Gambar 4.1 Grafik Histogram (Uji Normalitas).....         | 63 |
| Gambar 4.2 Grafik Probability Plots (Uji Normalitas)..... | 64 |
| Gambar 4.3 Grafik Scatterplot (Uji Heterokesdasitas)..... | 67 |



## DAFTAR LAMPIRAN

|   |     |
|---|-----|
| 1. Sampel Perusahaan.....                       | 92  |
| 2. Data Perhitungan ROE Tahun 2013 – 2015.....  | 93  |
| 3. Data Perhitungan DER Tahun 2013 – 2015.....  | 96  |
| 4. Data Perhitungan EPS Tahun 2013 – 2015 ..... | 99  |
| 5. Analisis Deskriptif.....                     | 102 |
| 6. Uji Asumsi Klasik.....                       | 103 |
| 7. Uji Hipotesis.....                           | 106 |

