

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	9
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian.....	10
1.4 Kegunaan penelitian.....	11
1.5 Lokasi dan waktu Penelitian	12
 BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Pasar modal	13
2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	13
2.1.2 Manfaat Pasar Modal	14
2.1.3 Peranan Pasar Modal.....	17
2.1.4 Jenis-jenis Pasar Modal.....	17
2.1.5 Instrumen Pasar Modal.....	18
2.2 Laporan Keuangan	20
2.2.1 Manfaat Laporan Keuangan	21
2.3 Analisis Rasio Keuangan.....	23
2.3.1 Jenis-jenis Rasio Keuangan.....	24
2.3.2 <i>Return On Equity (ROE)</i>	25
2.3.3 <i>Return On Asset (ROA)</i>	26

2.3.4	<i>Earning Per Share</i>	28
2.4	Saham	29
2.4.1	Pengertian dan jenis-jenis saham	29
2.4.2	Harga Saham	32
2.4.2.1	Faktor-faktor yang mempengaruhi harga saham	33
2.5	<i>Return</i> Saham	35
2.6	Kerangka Pemikiran	37
2.7	Penelitian terdahulu	41
2.8	Hipotesis	43

BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian	44
3.2	Populasi dan sampel	45
3.2.1	Populasi	45
3.2.2	Sampel	45
3.3	Jenis dan sumber data	46
3.3.1	Jenis Data	46
3.3.2	Sumber Data	47
3.4	Teknik Pengumpulan data	47
3.5	Teknik Pengolahan data	48
3.6	Metode Penelitian	49
3.6.1	Desain Penelitian	49
3.6.2	Tipe Investigasi	49
3.6.3	Unit analisis	50
3.6.4	Dimensi waktu	50
3.6.5	Operasionalisasi variabel	50
3.7	Metode Analisis data	52
3.7.1	Uji asumsi klasik	52
3.7.1.1	Uji normalitas	53
3.7.1.2	Uji multikolinearitas	53
3.7.1.3	Uji heteroskedastisitas	54

3.7.1.4 Uji Autokorelasi	54
3.7.2 Uji kecocokan model (<i>goodness and fit</i>).....	55
3.7.3 Persamaan regresi linier berganda	56
3.7.4 Pengujian hipotesis.....	57
3.7.4.1 Pengujian signifikansi parameter parsial (uji t).	57
3.7.4.2 Pengujian signifikansi simultan (uji f)	57
3.8 Penetapan tingkat signifikansi	58

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Gambaran umum Bursa Efek Indonesia	59
4.2 Hasil Penelitian	62
4.2.1 Lingkungan makro perusahaan sektor industry barang konsumsi	62
4.2.2 Perkembangan <i>Return On Equity</i> sektor industry barang konsumsi periode 2010-2014	63
4.2.3 Perkembangan <i>Return On Asset</i> sektor industry barang konsumsi periode 2010-2014	68
4.2.4 Perkembangan <i>Earning Per Share</i> sektor industry barang konsumsi periode 2010-2014	68
4.2.5 Perkembangan <i>Return Saham</i> sektor industry barang konsumsi periode 2010-2014	71
4.3 Pengaruh ROE, ROA, EPS terhadap <i>Return Saham</i> pada perusahaan manufaktur sektor industry barang konsumsi	73
4.3.1 Uji Asumsi klasik	74
4.3.1.1 Uji normalitas.....	74
4.3.1.2 Uji Heteroskedastisitas.....	75
4.3.1.3 Uji Multikolinieritas.....	77
4.3.1.4 Uji Autokorelasi	78
4.3.2. Persamaan Regresi linier berganda	79
4.3.3. Analisis korelasi	80
4.3.4. Analisis Koefisien determinasi.....	81

4.3.5. Pengujian Hipotesis.....	83
4.3.5.1 Pengujian hipotesis simultan.....	83
4.3.5.1 Pengujian hipotesis parsial.....	84

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	89
5.2 Saran	90

DAFTAR PUSTAKA..... 91

LAMPIRAN

