DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN .....

SURAT PERNYATAAN KEASLIAN ii

ABSTRACT.....iii

ABSTRAK iv

KATA PENGANTAR v

DAFTAR ISI vii

DAFTAR GAMBAR xi

DAFTAR TABEL xii

DAFTAR LAMPIRAN xiv

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah 1

1.2 Identifikasi Masalah 6

1.3 Rumusan Masalah 7

1.4 Maksud dan Tujuan Penelitian 8

1.4.1 Maksud Penelitian 8

1.4.2 Tujuan Penelitian 8

1.5 Kegunaan Penelitian 9

1.5.1 Kegunaan Praktis 9

1.5.2 Kegunaan Akademis 9

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka 10

2.1.1 Price Earning Ratio 10

2.1.1.1 Pengertian Price Earning Ratio.....10

2.1.1.2 Indikator Price Earning Ratio 10

2.1.2 Return on Asset.....10

2.1.2.1 Pengertian Return on Asset.....10

2.1.2.2 Indikator Return on Asset 11

2.1.3 Return Saham 12

2.1.3.1 Pengertian Return Saham.....12

2.1.3.2 Indikator Return Saham 12

2.2 Kerangka Pemikiran 13

2.2.1 Pengaruh Price Earning Ratio terhadap Return Saham 13

2.2.2 Pengaruh Return on Asset terhadap Return Saham 14

2.3 Hipotesis 17

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1Metode Penelitian 18

3.2Operasionalisasi Variabel..... 19

3.3 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data.....22

3.3.1 Sumber Data 22

3.3.2 Teknik Pengumpulan Data 22

3.4 Populasi, Sampel Dan Tempat Serta Waktu Penelitian 23

3.4.1 Populasi 23

3.4.2 Penarikan Sampel.....26

3.4.3 Tempat dan Waktu Penelitian 30

3.5 Metode Analisis Data 31

BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN

1.1 Hasil Penelitian .....

1.1.1 Hasil Analisis Deskriptif 48

4.1.1.1 Analisis Price Earning Ratio 49

4.1.1.2 Analisis Return On Asset 53

4.1.1.3 Analisis Return Saham 57

1.1.2 Hasil Analisis Verifikatif.....63

4.1.2.1 Analisis Pengaruh Price Earning Ratio dan Return on Asset terhadap Return Saham

63

1.1.2.1 Uji Asumsi Klasik 63

1.1.2.2 Analisis Regresi Linier Berganda 68

1.1.2.3 Analisis Korelasi 71

1.1.2.4 Koefisien Determinasi.....73

1.1.2.5 Pengujian Hipotesis.....74

4.2 Pembahasan 78

4.2.1 Pengaruh Price Earning Ratio terhadap Return saham.....79

4.2.2 Pengaruh Return on Asset terhadap Return Saham.....80

4.2.3 Pengaruh PER dan ROA terhadap Return saham.....81

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 83

5.2 Saran 84

5.2.1 Saran Operasional 84

5.2.2 Saran Akademik.....84

DAFTAR PUSTAKA 85

LAMPIRAN-LAMPIRAN 88

DAFTAR RIWAYAT HIDUP 102