DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

SURAT PERNYATAAN KEASLIAN

SURAT KETERANGAN PERSETUJUAN PUBLIKASI

ABSTRACT iv

ABSTRAK v

KATA PENGANTAR vi

DAFTAR ISI viii

DAFTAR GAMBAR xiii

DAFTAR TABEL xiv

DAFTAR LAMPIRAN xvi

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian 1

1.2 Identifikasi Masalah 10

1.3 Rumusan Masalah 11

1.4 Maksud dan Tujuan Penelitian 11

1.4.1 Maksud Penelitian 11

1.4.2 Tujuan Penelitian 12

1.5 Kegunaan Penelitian 12

1.5.1 Kegunaan Praktis 12

1.5.2 Kegunaan Akademis 13

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka 15

2.1.1 *Return on Equity* (ROE) 15

2.1.1.1 Pengertian *Return on Equity* (ROE)..... 15

2.1.1.2 Perhitungan *Return on Equity* (ROE) 16

2.1.1.3 Indikator *Return on Equity* (ROE) 16

2.1.1.4 Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi *Return on Equity* (ROE) 17

2.1.2 *Earning Per Shares* (EPS)..... 18

2.1.2.1 Pengertian *Earning Per Shares* (EPS) 18

2.1.2.2 Perhitungan *Earning Per Shares* (EPS) 19

2.1.2.3 Indikator *Earning Per Shares* (EPS)..... 19

2.1.2.4 Prospek *Earning Per Shares* (EPS) 21

2.1.2.5 Faktor-Faktor Penyebab Kenaikan dan Penurunan *Earning Per Shares* (EPS) 22

2.1.3 *Return* Saham 23

2.1.2.1 Pengertian *Return* Saham..... 23

2.1.2.2 Perhitungan *Return* Saham..... 23

2.1.2.3 Indikator *Return* Saham 24

2.1.2.4 Komponen *Return* Saham 25

2.2 Kerangka Pemikiran 27

2.2.1 Hubungan antara *Return on Equity* Terhadap *Return* Saham Pemikiran 27

2.2.2 Hubungan anatara *Earning Per Shares* Terhadap *Return* Saham 29

2.3 Hipotesis Pemikiran 33

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Metodologi Penelitian 34

3.2 Operasionalisasi Variabel 36

3.3 Sumber Data 38

3.4 Populasi, Sampel dan Tempat serta Waktu Penelitian 40

3.4.1 Populasi 40

3.4.2 Sampel 41

3.4.3 Tempat serta Waktu Penelitian 42

3.4.3.1 Tempat Penelitian 42

3.4.3.2 Waktu Penelitian 43

3.5 Metode Pengumpulan Data 44

3.6 Metode Pengujian Data 45

3.6.1 Rancangan Analisis 45

3.6.1.1 Uji Asumsi Klasik 46

3.6.1.2 Analisis Korelasi 52

3.6.1.3 Analisis Korelasi Determinasi 54

3.6.2 Pengujian Hipotesis 54

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian 60

4.1.1 Hasil Analisi Deskriptif 60

4.1.1.1 Perkembangan *Return On Equity* (ROE) Pada Perusahaan Manufaktur Sektor *Food And Beverage* Yang Terdaftar Di BEI Periode 2012-2013 60

4.1.1.2 Perkembangan *Earning Per Shares* (EPS) Pada Perusahaan Manufaktur Sektor *Food and Beverage* Yang Terdaftar di BEI periode 2012-2013 65

4.1.1.3 Perkembangan *Return* Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sektor *Food and Beverage* Yang Terdaftar di BEI periode 2012-2013 70

4.1.2 Analisis Regresi *Return On Equity* (ROE) dan *Earning Per Shares* (EPS) terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sektor *Food and Beverage* Yang Terdaftar di BEI periode 2012-2013 74

4.1.2.1 Uji Asumsi Klasik 74

4.1.2.2 Persamaan Regresi Linier Berganda 80

4.1.2.3 Analisis Korelasi 81

4.1.2.4 Analisis Koefisien Determinasi 83

4.1.2.5 Pengujian Hipotesis Simultan (Uji F) 84

4.1.2.6 Pengujian Hipotesis Parsial (Uji t)..... 85

4.2 Pembahasan 87

4.2.1 Pengaruh *Return On Equity* Terhadap *Return* Saham..... 87

4.2.2 Pengaruh *Earning Per Share* Terhadap *Return* Saham... 89

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 90

5.2 Saran 92

DAFTAR PUSTAKA 94