DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

MOTTO

ABSTRACT i

ABSTRAK ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR GAMBAR vii

DAFTAR TABEL viii

DAFTAR LAMPIRAN ix

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 11

1.2.1 Identifikasi Masalah 11

1.2.2 Rumusan Masalah 12

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 12

1.3.1 Maksud Penelitian 12

1.3.2 Tujuan Penelitian 13

1.4 Kegunaan Penelitian 13

1.4.1 Kegunaan Praktis 13

1.4.2 Kegunaan Akademis 14

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian. 15

1.5.1 Lokasi Penelitian 15

1.5.2 Waktu Penelitian 16

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka. 17

2.1.1 Return On Equity (ROE)…. 17

2.1.1.1 Pengetian Return On Equity (ROE) 17

2.1.1.2 Faktor-faktor yang mempengaruhi *Return On Equity* 18

2.1.2 Likuiditas 19

2.1.2.1 Pengertian Likuiditas 19

2.1.2.2 Faktor-faktor yang mempengaruhi Likuiditas 20

2.1.2.3 Komponen-Komponen Likuiditas 21

2.1.2.4 Ukuran Rasio Likuiditas 21

2.1.3 *Return* Saham 27

2.1.3.1 Penertian *Return* Saham 27

2.1.3.2 Pengukuran *Return* Realisasian 28

2.1.3.3 Faktor-faktor yang mempengaruhi *Return* Saham 31

2.1.4 Hasil Penelitian Sebelumnya 32

2.2 Kerangka Pemikiran 34

2.2.1 Hubungan antara *return on equity* (ROE) dengan *Return* Saham 38

2.2.2 Hubungan antara Likuiditas dengan *Return* Saham 40

2.3 Hipotesis. 42

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian. 43

3.2 Metode Penelitian. 43

3.2.1 Desain Penelitian 45

3.2.2 Operasionalisasi Variabel 48

3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data 50

3.2.3.1 Sumber Data 50

3.2.3.2 Teknik Penentuan Data 51

3.2.4 Teknik Pengumpulan Data 55

3.2.5 Metoda Analisis dan Pengujian Hipotesis 56

3.2.5.1 Metoda Analisis 56

3.2.5.2 Pengujian Hipotesis 64

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian 68

4.1.1 Gambaran Umum Bursa Efek Indonesia 68

4.1.1.1 Sejarah Bursa Efek Indonesia 68

4.1.1.2 Sejarah Perusahaan Otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia 70

4.1.1.3 Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia 78

4.1.1.4 Struktur Perusahaan Otomotif yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia` 80

4.1.1.5 Aktivitas Bursa Efek Indonesia 84

4.1.2 Analisis Deskriptif 84

4.1.2.1 Deskriptif ROE Pada Perusahaan Otomotif Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2012 84

4.1.2.2 Deskriptif Likuiditas Pada Perusahaan Otomotif Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2012 91

4.1.2.3 Deskriptif *Return* Saham Pada Perusahaan Otomotif Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2012 98

4.1.3 Analisis Verifikatif 104

4.1.3.1 Pengaruh ROE Terhadap *Return* Saham 113

4.1.3.2 Pengaruh Likuiditas Terhadap *Return* Saham 118

4.1.3.3 Pengaruh ROE dan Likuiditas Terhadap *Return* Saham 122

4.2 Pembahasan 127

4.2.1 Pengaruh ROE Terhadap *Return* Saham 127

4.2.2 Pengaruh Likuiditas Terhadap *Return* Saham 129

4.2.3 Pengaruh ROE dan Likuiditas Terhadap *Return* Saham 131

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 133

5.2 Saran 134

5.2.1 Saran Praktis 134

5.2.2 Saran Akademik 135

DAFTAR PUSTAKA. 137

LAMPIRAN-LAMPIRAN 142

DAFTAR RIWAYAT HIDUP ...283