DAFTAR ISI

Hal.

LEMBAR PENGESAHAN

LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN

SURAT PUBLIKASI

ABSTRACT ..... **i**

ABTRAK ..... **ii**

KATA PENGANTAR ..... **iii**

DAFTAR ISI ..... **vi**

DAFTAR GAMBAR ..... **x**

DAFTAR TABEL ..... **xi**

DAFTAR LAMPIRAN ..... **xiii**

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian 1

1.2 Identifikasi Masalah 10

1.3 Rumusan Masalah 10

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 (Memecahkan Masalah / *Applied Research)* 12

1.5.1 Kegunaan Akademis (Pengembangan Ilmu / *Basic Research*) 13

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka 14

2.1.1 *Total Asset Turn Over* 14

2.1.1.1 Pengertian *Total Asset Turn Over* 14

2.1.1.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi TATO 15

2.1.1.3 Indikator *Total Asset Turn Over* 16
2.1.2 *Earning Per Share* 17
2.1.2.1 Pengertian *Earning Per Share* 17
2.1.2.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi EPS 18
2.1.2.3 Indikator *Earning Per Share* 18
2.1.3 *Return* Saham 19
2.1.3.1 Pengertian *Return* Saham 19
2.1.3.2 Jenis-Jenis *Return* Saham 20
2.1.3.3 Unsur *Return* Saham 21
2.1.3.4 Indikator *Return* Saham 22
2.1.3.5 Faktor-Faktor yang mempengaruhi *Return* Saham 22
2.2 Kerangka Pemikiran 23
2.2.1 Pengaruh TATO Terhadap *Return* Saham 24
2.2.2 Pengaruh EPS Terhadap *Return* Saham 25
2.2.3 Paradigma Pelitian 25
2.3 Hipotesis 26

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Metode Penelitian 28
3.2 Operasionalisasi Variabel 29
3.3 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data 32
3.3.1 Sumber Data 32
3.3.2 Teknik Pengumpulan Data 33
3.4 Populasi, Sampel dan Tempat Serta Waktu Penelitian 34
3.4.1 Populasi Penelitian 34
3.4.2 Sampel Penelitian 35
3.4.3 Tempat dan Waktu Penelitian 38
3.4.3.1 Tempat Penelitian 38
3.4.3.2 Waktu Penelitian 39
3.5 Metode Pengumpulan Data 40
3.6 Metode Pengujian Data 41
3.6.1 Rancangan Analisis 41

3.6.1.1 Analisis Kuantitatif 41
3.6.2 Uji Hipotesis.....49
3.6.2.1 Pengujian Secara Parsial (Uji Statistik T).....50
3.6.2.2 Menggambar Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis 50
3.6.3.3 Penarikan Kesimpulan.....51

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian 52
4.1.1 Hasil Analisis Deskriptif 52
4.1.1.1 Analisis *Total Asset Turn Over* pada perusahaan sektor barang konsumsi yang terdaftar di BEI Periode 2011-2015 53
4.1.1.2 Analisis *Earning Per Share* pada perusahaan sektor barang konsumsi yang terdaftar di BEI Periode 2011-2015 58
4.1.1.3 Analisis *Return* Saham pada perusahaan sektor barang konsumsi yang terdaftar di BEI Periode 2011-2015 63
4.1.2 Hasil Analisis Verifikatif 69
4.1.2.1 Analisis Pengaruh *Total Asset Turn Over* dan *Earning Per Share* Terhadap *Return* Saham.....69
4.1.2.2 Uji Asumsi Klasik 70
4.1.2.3 Uji Regresi Berganda.....77
4.1.2.4 Analisis Koefisien Korelasi 78
4.1.2.5 Analisis Koefisien Determinasi 80
4.1.2.6 Pengujian Hipotesis.....81
4.2 Hasil Pembahasan 86
4.2.1 Pengaruh *Total Asset Turn Over* terhadap *Return* Saham.....86
4.2.2 Pengaruh *Earning Per Share* terhadap *Return* Saham 88

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.2 Kesimpulan.....91
5.2 Saran.....92
5.2.1 Saran Operasional.....92
5.2.2 Saran Akademik 93

DAFTAR PUSTAKA.....94
LAMPIRAN.....100
DAFTAR RIWAYAT HIDUP 136