

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINILITAS.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS.....	vii
ABSTRAK.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian.....	3
1.3 Perumusan Masalah.....	8
1.4 Tujuan Penelitian.....	9
1.5 Kegunaan Penelitian.....	9
1.5.1 Aspek Teoritis.....	9
1.5.2 Aspek Praktis.....	9
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....	13
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian.....	13
2.1.1 Investasi.....	13
2.1.2 Saham.....	13
2.1.3 <i>Economic Value Added</i> (EVA).....	17
2.1.4 <i>Return On Assets</i> (ROA).....	20
2.1.5 <i>Return On Equity</i> (ROE).....	21
2.1.6 Inflasi.....	22
2.1.7 Suku Bunga.....	23
2.2 Penelitian Terdahulu.....	24

2.2.1 Penelitian Terdahulu.....	24
2.2.2 Perbedaan dan Persamaan dengan Penelitian Terdahulu.....	31
2.3 Kerangka Pemikiran.....	34
2.4 Hipotesis Penelitian.....	37
2.5 Ruang Lingkup Penelitian.....	37
2.5.1 Variabel Penelitian.....	37
2.5.2 Lokasi dan Objek Penelitian.....	38
2.5.3 Waktu dan Periode Penelitian.....	38
BAB III METODE PENELITIAN.....	39
3.1 Jenis Penelitian.....	39
3.2 Variabel Operasional.....	40
3.2.1 Variabel Independen.....	40
3.2.2 Variabel Dependen.....	41
3.3 Tahapan Penelitian.....	44
3.4 Populasi dan Sampel.....	47
3.4.1 Populasi Penelitian.....	47
3.4.2 Sampel Penelitian.....	47
3.5 Pengumpulan Data.....	48
3.6 Teknik Analisis Data.....	49
3.6.1 Statistik Deskriptif.....	49
3.6.2 Analisis Regresi Data Panel.....	50
3.6.3 Pemilihan Metode Estimasi Regresi Data Panel.....	50
3.6.4 Pengujian Hipotesis.....	54
3.6.4.1 Uji Parsial (Uji t).....	54
3.6.4.2 Uji Simultan (Uji F).....	54
3.6.4.3 Koefisien Determinasi (R^2).....	55
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	57
4.1 Analisis Statistik Deskriptif Variabel <i>Economic Value Added</i> , <i>Return On Assets</i> , <i>Return On Equity</i> , Tingkat Inflasi, Tingkat Suku Bunga, dan <i>Return Saham</i>	57

4.1.1	<i>Economic Value Added</i>	57
4.1.2	<i>Return On Assets</i>	58
4.1.3	<i>Return On Equity</i>	59
4.1.4	Tingkat Inflasi.....	60
4.1.5	Tingkat Suku Bunga.....	60
4.1.6	<i>Return Saham</i>	61
4.2	Pemilihan Metode Estimasi Regresi Data Panel.....	62
4.3	Persamaan Regresi Data Panel.....	66
4.4	Pengujian Hipotesis.....	68
4.4.1	Uji Parsial (Uji t).....	68
4.4.2	Uji Simultan (Uji F).....	70
4.4.3	Koefisien Determinasi (R^2).....	70
4.5	Analisis dan Pembahasan.....	71
4.5.1	Pengaruh <i>Economic Value Added</i> (EVA) Terhadap <i>Return Saham</i>	71
4.5.2	Pengaruh <i>Return On Assets</i> (ROA) Terhadap <i>Return</i> <i>Saham</i>	72
4.5.3	Pengaruh <i>Return On Equity</i> (ROE) Terhadap <i>Return</i> <i>Saham</i>	73
4.5.4	Pengaruh Tingkat Inflasi Terhadap <i>Return Saham</i>	74
4.5.5	Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI Terhadap <i>Return</i> <i>Saham</i>	75
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	77
5.1	Kesimpulan.....	77
5.2	Saran.....	79
5.2.1	Aspek Teoritis.....	79
5.2.2	Aspek Praktis.....	80
	DAFTAR PUSTAKA	81
	LAMPIRAN	87