

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	7
1.4 Pertanyaan Penelitian	7
1.5 Tujuan Penelitian	8
1.6 Manfaat Penelitian	8
1.6.1 Aspek Teoritis	9
1.6.2 Aspek Praktis	9
1.7 Ruang Lingkup Penelitian	9
1.7.1 Lokasi dan Objek Penelitian	9
1.7.2 Waktu dan Periode Penelitian	9
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	11
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	11
2.1.1 Saham	11
2.1.1.1 <i>Return</i> Saham	12
2.1.2 Rasio Profitabilitas.....	12
2.1.3 Rasio Solvabilitas.....	15

2.1.4 Rasio Nilai Pasar	17
2.1.5 Penelitian Terdahulu	19
2.2 Kerangka Pemikiran	28
2.2.1 Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	29
2.2.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	29
2.2.3 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	30
2.3 Hipotesis Penelitian	32
BAB III METODE PENELITIAN	33
3.1 Karakteristik Penelitian	33
3.2 Operasionalisasi Variabel	34
3.2.1 Variabel Independen	34
3.2.2 Variabel Dependen	34
3.3 Tahapan Penelitian	35
3.4 Populasi dan Sampel	36
3.4.1 Populasi	36
3.4.2 Sampel	36
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	38
3.6 Teknik Analisis Data	39
3.6.1 Statistik Deskriptif	39
3.6.2 Analisis Regresi	39
3.6.2.1 Model <i>Common-Constant (Pooled Ordinary Least Square/PLS)</i>	40
3.6.2.2 Model <i>Fixed Effect (Fixed Effect Model/FEM)</i>	41
3.6.2.3 Model <i>Random Effect (Random Effect Model/REM)</i>	41
3.6.3 Pemilihan Teknik Regresi Data Panel	41
3.6.3.1 Uji Chow (Uji Signifikansi <i>Fixed Effect</i>)	41
3.6.3.2 Uji <i>Lagrange Multiplier</i> (Uji Signifikansi <i>Random Effect</i>)	42
3.6.3.3 Uji Hausmann (Uji Signifikansi <i>Fixed Effect</i> atau <i>Random Effect</i>)	42
3.7 Pengujian Hipotesis	43
3.7.1 Analisis Koefisien Determinasi	43

3.7.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	43
3.7.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji t)	44
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	45
4.1 Analisis Statistik Deskriptif	45
4.1.1 Net Profit Margin	46
4.1.2 Debt To Equity Ratio	48
4.1.3 Earning Per Share	50
4.1.4 Return Saham	51
4.2 Analisis Regresi Data Panel	53
4.2.1 Pemilihan Teknik Regresi Data Panel	53
4.2.1.1 Uji Chow	53
4.2.1.2 Uji Lagrange Multiplier	54
4.2.1.3 Uji Hausmann	56
4.2.2 Hasil Analisis Data Panel	57
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis Dan Pembahasan	59
4.3.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	59
4.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	59
4.3.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji t)	60
4.3.4 Pembahasan.....	60
4.3.4.1 Pengaruh Net Profit Margin Terhadap Return Saham	60
4.3.4.2 Pengaruh Debt To Equity Ratio Terhadap Return Saham	61
4.3.4.3 Pengaruh Earning Per Share Terhadap Return Saham	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	65
5.1 Kesimpulan	65
5.2 Saran	67
DAFTAR PUSTAKA	69
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

1.1 Perkembangan Jumlah kendaraan di Indonesia tahun 2010-2014	1
2.1 Penelitian Terdahulu	23
3.1 Karakteristik Penelitian	33
3.2 Operasionalisasi Variabel	34
3.3 Kriteria Pemilihan Sampel Perusahaan	37
3.4 Daftar Sampel Perusahaan	38
4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif	45
4.2 Net Profit Margin Perusahaan Sub Sektor Otomotif Tahun 2011-2015	47
4.3 Debt To Equity Ratio Perusahaan Sub Sektor Otomotif Tahun 2011-2015	49
4.4 Earning Per Share Perusahaan Sub Sektor Otomotif Tahun 2011-2015	51
4.5 Return Saham Perusahaan Sub Sektor Otomotif Tahun 2011-2015	52
4.6 Hasil Uji Statistik Menggunakan Uji Chow	54
4.7 Hasil Uji Statistik Menggunakan Uji Lagrange Multiplier	55
4.8 Hasil Uji Statistik Menggunakan Uji Hausmann	56
4.9 Hasil Uji Common Effect	57
4.10 Uji Parsial (Uji t)	60