

DAFTAR ISI

HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang	3
1.3 Rumusan Masalah	13
1.4 Tujuan Penelitian.....	14
1.5 Manfaat Penelitian.....	15
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	17
2.1 Landasan Teori	17
2.2 Penelitian Terdahulu.....	31
2.3 Kerangka Pemikiran	44
2.4 Hipotesis Penelitian	46
BAB III METODE PENELITIAN	48
3.1 Jenis Penelitian	48
3.2 Operasional Variabel	50
3.3 Tahapan Penelitian	52
3.4 Populasi dan Sampel	53
3.5 Pengumpulan Data	54
3.6 Teknik Analisis Data	55
3.6.1 Uji Asumsi Klasik.....	55
3.6.2 Uji Statistik	57
3.6.3 Pemilihan Model Regresi Data Panel	57
3.6.4 Penentuan Model Estimasi Data Panel	60

3.6.5	Keunggulan Data Panel.....	62
3.6.6	Uji Koefisien Determinasi	62
3.6.7	Uji Signifikansi Simultan (Uji-F).....	63
3.6.8	Uji Parsial (Uji-t).....	63
3.6.9	Aplikasi EViews 10	64
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		65
4.1	Hasil Penelitian.....	65
4.1.1	Harga Penutupan Saham	65
4.1.2	Hasil Perhitungan Beta Saham, <i>Current Rasio</i> , <i>Total Aset Turn Over</i> , <i>Debt to Equity Rasio</i> , <i>Return on Equity</i>	71
4.1.2.1	Beta Saham	71
4.1.2.2	<i>Current Rasio</i>	72
4.1.2.3	<i>Total Asset Turn Over</i>	73
4.1.2.4	<i>Debt to Equity Rasio</i>	73
4.1.2.5	<i>Return on Equity</i>	73
4.1.3	Uji Asumsi Klasik.....	74
4.1.4	Uji Estimasi Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	76
4.2	Pembahasan Hasil Penelitian.....	82
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		87
5.1	Kesimpulan.....	87
5.2	Saran	88
DAFTAR PUSTAKA		90
LAMPIRAN.....		93