

DAFTAR ISI

Halaman

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL

DAFTAR LAMPIRAN

I. PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	9

II. LANDASAN TEORI

2.1 Landasan Teori	
2.1.1 <i>Return</i> saham	11
2.1.2 <i>Signalling Theory</i> (Teori Sinyal)	13
2.1.3 <i>Arbitrage Pricing Theory (APT)</i>	14
2.2 Faktor Eksternal	16
2.2.1 Nilai Tukar	17
2.2.2 Inflasi	18
2.3 Faktor Internal	22
2.3.1 Solvabilitas	22
2.3.2 Profitabilitas	23
2.4 Pengaruh Nilai Tukar Terhadap <i>Return</i> Saham	25
2.5 Pengaruh Inflasi Terhadap <i>Return</i> Saham	27
2.6 Pengaruh <i>Profitabilitas</i> (ROA) Terhadap <i>Return</i> Saham	28
2.7 Pengaruh Solvabilitas (DER) Terhadap <i>Return</i> Saham	29

2.8	Peneliti Terdahulu	31
2.9	Rerangka Pemikiran Teoretis	33
2.10	Perumusan Hipotesis	33

III. METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Jenis Dan Sumber Data	34
3.2	Sampel Penelitian	34
3.3	Metode Pengumpulan Data	36
3.4	Metode Analisis Data	37
3.5	Definisi Operasional Variabel	37
3.6	Teknik Analisis Data	41
3.7	Analisis Statistik Deskriptif	41
3.8	Uji Asumsi Klasik	41
3.8.1	Uji Normalitas	41
3.8.2	Uji Multikolinearitas	41
3.8.3	Uji Autokorelasi	42
3.8.4	Uji Heteroskedastisitas	42
3.9	Pengujian Hipotesis	43
3.9.1	Model Regresi Berganda	43
3.9.2	Koefisien Determinasi	44

IV. HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Deskripsi Objek Penelitian	46
4.2	Pengujian Analisis Data Statistik Deskriptif	48
4.3	Uji Asumsi Klasik	50
4.3.1	Uji Normalitas	50
4.3.2	Uji Heteroskedastisitas	51
4.3.3	Uji Multikolinearitas	52
4.3.4	Uji Autokorelasi	53
4.4	Pengujian Hipotesis	54
4.4.1	Analisis Regresi Berganda	54

4.5 Pembahasan Hipotesis	56
4.5.1 Pembahasan Hipotesis 1	56
4.5.2 Pembahasan Hipotesis 2	57
4.5.3 Pembahasan Hipotesis 3	57
4.5.4 Pembahasan Hipotesis 4	58
4.6 Pengujian Model ANNOVA	61
4.7 Analisis Koefisien Determinasi (R^2)	62

V. KESIMPULAN

5.1 Simpulan	63
5.2 Keterbatasan Penelitian	64
5.3 Saran	64

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN