

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	i
DAFTAR GAMBAR	ii
DAFTAR LAMPIRAN	iii
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Permasalahan	7
1.3 Tujuan Penelitian	10
1.4 Manfaat Penelitian	11
1.5 Ruang Lingkup Penelitian	11
1.6 Kerangka Pemikiran	12
1.7 Hipotesis	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1 Penelitian Terdahulu	14
2.2 Investasi	15
2.3 Investasi Dalam Bentuk Saham	14
2.4 Langkah Investor Dalam Mengambil Keputusan Investasi	17
2.5 Perindustrian	18
2.6 Pangsa Pasar	19
2.7 <i>Return</i> Saham	20
BAB III METODE PENELITIAN	24
3.1 Jenis dan sumber data	24
3.2 Metode analisis dan pengolahan data	24
3.2.1 Pangsa Pasar (<i>Market Share</i>)	25

3.2.2 <i>Return</i> Saham	26
3.2.3 Analisis Regresi Sederhana	26
3.3 Evaluasi Model	28
3.3.1 Uji asumsi Klasik	28
3.3.2 Uji Hipotesis	33
3.4 Definisi Operasional	34
3.4.1 Variabel Independen (X)	34
3.4.2 Variabel Dependen (Y)	34
BAB IV PEMBAHASAN	28
4.1 Hasil dan Pembahasan	35
4.1.2 Hasil Pengujian Hipotesis	35
4.1.2.1 Pengujian Hipotesis	35
4.2 Analisis Data dan Interpretasi	37
4.2.1 Analisis Regresi Linear Berganda	37
4.3 Implikasi Hasil Penelitian	38
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	40
5.1 Kesimpulan	40
5.2 Saran	40

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
1.1 Nilai Produk Domestik Bruto (PDB) Pada Beberapa Sektor Usaha dan Nasional Atas Dasar Harga Konstan (Milyar Rp)	1
1.2 Perkembangan Perubahan Harga Saham Sektor Industri Barang Konsumsi Periode Tahun 2008-2011	3
1.3 <i>Output</i> Perusahaan-Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang Terdaftar di BEI Periode 2008-2011	6
3.1 Hasil Uji Normalitas	29
3.2 Uji Multikolinearitas <i>Variance Inflation Factor (VIF)</i>	31
3.3 Tingkat pengujian autokorelasi	31
3.4 Pengujian Asumsi autokorelasi (X1 dan X2) Terhadap Y	32
4.1 Pengujian Hipotesis	35
4.5 Hasil Analisis Regresi	37

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Halaman
1.1 <i>Return</i> Indeks Saham Sektoral BEI 2008 (%)	4
1.2 Sepuluh Kelompok Hasil Industri Dengan Nilai Ekspor Terbesar	9
1.3 Sepuluh Kelompok Hasil Industri Dengan Nilai Impor Terbesar	9
1.4 Skema Penelitian	12

DAFTAR LAMPIRAN

1. Tabel Kode Nama Emiten sektor Industri Barang Konsumsi
2. Tabel Penjualan (*Sales*) Sektor Industri Barang Konsumsi (Periode 2008-2011)
3. Tabel Indeks Harga Saham Sektor Industri Barang Konsumsi (Periode 2008-2011)
4. Tabel Pangsa Pasar (*Market Share*) Sektor Industri Barang Konsumsi (Periode 2008-2011)
5. Tabel *Return* Saham Sektor Industri Barang Konsumsi Periode (2008-2011)
6. Output SPSS
7. Laporan Keuangan Sektor Industri Barang Konsumsi Periode 2008-2011