

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN PENGUJI.....	iii
HALAMAN MOTTO	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR GRAFIK	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
ABSTRAK	xvi
ABSTRACT.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Identifikasi Masalah.....	17
C. Rumusan Masalah.....	17
D. Tujuan Penelitian	18
E. Manfaat Penelitian	18

F. Ruang Lingkup dan Keterbatasan Penelitian	19
G. Penegasan Istilah.....	20
H. Sistematika Penulisan Skripsi	23
BAB II LANDASAN TEORI.....	26
A. Pasar Modal.....	26
B. <i>Return Saham</i>	29
C. Kapitalisasi Pasar	33
D. Rasio Keuangan	35
1. Rasio Solvabilitas (<i>Debt to Equity Ratio</i>)	36
2. Rasio Likuiditas (<i>Current Ratio</i>)	38
3. Rasio Profitabilitas (<i>Return on Asset</i>)	40
E. Penelitian Terdahulu.....	42
F. Kerangka Konseptual	49
G. Hipotesis Penelitian	50
BAB III METODE PENELITIAN	52
A. Pendekatan dan Jenis Penelitian	52
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian	53
C. Sumber Data, Variabel dan Skala Pengukuran	56
D. Teknik Pengumpulan Data.....	58
E. Teknik Analisis Data	59
1. Uji Regresi Data Panel	59
a. Metode Estimasi Model	61
b. Tahapan Analisis Data Panel.....	62

2. Pengujian Hipotesis	64
a. Uji Koefisien Regresi Secara Parsial (Uji T).....	64
b. Uji Koefisien Regresi Secara Simultan (Uji F)	64
c. Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	65
BAB IV HASIL PENELITIAN	66
A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	66
B. Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	77
1. Tahapan Analisis Data	77
a. Uji <i>Chow</i>	77
b. Uji <i>Hausman</i>	78
2. Hasil Uji Hipotesis Data.....	79
a. Uji Koefisien Regresi Secara Parsial (Uji T).....	80
b. Uji Koefisien Regresi Secara Parsial (Uji F)	83
c. Uji Koefisien Determinasi (R ²)	85
BAB V PEMBAHASAN	87
A. Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap Tingkat Pengambalian (<i>Return</i>) Saham pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45.....	87
B. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) Terhadap Tingkat Pengambalian (<i>Return</i>) Saham pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45	90

C. Pengaruh <i>Current Ratio</i> (CR) Terhadap Tingkat Pengambalian (<i>Return</i>) Saham pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45.....	92
D. Pengaruh <i>Return on Asset</i> (ROA) Terhadap Tingkat Pengambalian (<i>Return</i>) Saham pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45.....	95
E. Pengaruh Kapitalisasi Pasar, <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER), <i>Current Ratio</i> (CR) dan <i>Return on Asset</i> (ROA) Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45	97
F. Implikasi Penelitian	98
BAB VI PENUTUP	100
A. Kesimpulan.....	100
B. Saran	102
DAFTAR PUSTAKA	104
LAMPIRAN-LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.2	Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks Saham LQ45	3
Tabel 3.1	Daftar Sampel Penelitian Perusahaan LQ45.....	55
Tabel 4.1	Hasil Uji <i>Chow</i>	78
Tabel 4.2	Hasil Uji <i>Hausman</i>	79
Tabel 4.3	Hasil Uji T.....	81
Tabel 4.4	Hasil Uji F.....	84
Tabel 4.5	Hasil Perhitungan Koefisien Determinasi.....	85

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Kerangka Konseptual	49
------------	---------------------------	----

DAFTAR GRAFIK

Grafik 1.1	Pertumbuhan Investor di Indonesia	1
Grafik 1.3	Tingkat Pengembalian (Return) Saham Perusahaan Indeks Saham LQ45 Tahun 2018-2020	6
Grafik 1.4	Kapitalisasi Pasar pada Perusahaan Indeks Saham LQ45 Tahun 2018-2020	8
Grafik 1.5	<i>Debt to Equity Ratio</i> Perusahaan Indeks Saham LQ45 Tahun 2018-2020	11
Grafik 1.6	<i>Current Ratio</i> pada Perusahaan Indeks Saham LQ45 Tahun 2018-2020	13
Grafik 1.7	<i>Return on Asset</i> Perusahaan yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Tahun 2018-2020	15

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Data Sekunder
- Lampiran 2 Contoh Laporan Keuangan
- Lampiran 3 Fundamental Perusahaan
- Lampiran 4 Uji *Common Effect Model*
- Lampiran 5 Uji *Fixed Effect Model*
- Lampiran 6 Uji *Chow*
- Lampiran 7 Uji *Hausman*
- Lampiran 8 Uji *Random Effect Model*
- Lampiran 9 Surat Pernyataan Keaslian Tulisan
- Lampiran 10 Daftar Riwayat Hidup Penulis
- Lampiran 11 Kendali Bimbingan Skripsi