

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR	iii
UCAPAN TERIMAKASIH	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Identifikasi Masalah	7
C. Rumusan Masalah	9
D. Maksud dan Tujuan Penelitian	9
E. Kegunaan Penelitian	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Landasan Teori	10
1. Investasi	10
a. Jenis-jenis Investasi	10
b. Instrumen Investasi di Pasar Modal	11
c. Teori Signal	11
2. Kinerja Keuangan	12
a. Macam-Macam Kinerja Keuangan	13
b. Profitabilitas	13
c. Jenis Rasio Profitabilitas	14
d. <i>Return on Asset</i> (ROA)	16
e. <i>Return on Equity</i> (ROE)	17
3. Saham	18
a. Keuntungan Saham	18
b. Risiko Saham	19
c. Jenis Saham	19
d. Harga Saham	21
e. Teknik Analisis Harga Saham	22
f. Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	23
B. Penelitian Terdahulu	24
C. Kerangka Pemikiran	25
D. Hipotesis Penelitian	28
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Desain Penelitian	29
B. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	30
C. Populasi dan Sampel	31

D. Teknik Pengumpulan Data.....	34
E. Teknik Analisis dan Pengujian Hipotesis	34
1. Analisis Data Penelitian	34
2. Analisis Pengujian Hipotesis	36
3. Regresi Linier Multipel.....	40
4. Uji Keberartian Regresi (Uji F)	45
5. Uji Keberartian Koefisien Regresi (Uji t).....	46

BAB IV PEMBAHASAN

A. Gambaran Obyek Penelitian	48
B. Deskripsi Hasil Penelitian.....	54
1. Gambaran ROA Sektor Pertanian	54
2. Gambaran ROE Sektor Pertanian	58
3. Gambaran Harga Saham Sektor Pertanian.....	61
C. Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	64
1. Pemilihan Model Regresi Data Panel	64
a. Uji Chow (<i>Likelihood Ratio</i>).....	64
2. Uji Asumsi Klasik.....	65
a. Uji Normalitas	65
b. Uji Linieritas	67
c. Uji Autokorelasi	68
d. Uji Multikolinieritas	70
e. Uji Heteroskedastisitas	70
3. Pengujian Hipotesis	71
a. Analisis Regresi Multipel.....	71
b. Uji Keberartian Regresi (Uji F).....	73
c. Uji Keberartian Koefisien Regresi (Uji t)	74
D. Pembahasan Hasil Penelitian	76

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan	80
B. Saran	80

DAFTAR PUSTAKA	81
-----------------------------	-----------

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Pergerakan Harga Saham Sektoral Tahun 2010-2014.....	3
Tabel 1.2	Pergerakan Harga Saham Rata-rata Tahun Sektor Pertanian	4
Tabel 1.3	Pertumbuhan Kapitalisasi Sektor Pertanian Tahun 2010- 2014	6
Tabel 3.1	Operasionalisasi Variabel.....	31
Tabel 3.2	Perusahaan yang Termasuk dalam Sektor Pertanian pada Tahun 2014	32
Tabel 3.3	Proses Pemilihan Sampel	33
Tabel 3.4	Sampel Penelitian	34
Tabel 4.1	<i>Return on Asset</i> (ROA) Sektor Pertanian tahun 2010-2014...	55
Tabel 4.2	<i>Return on Equity</i> (ROE) Sektor Pertanian tahun 2010-2014 .	58
Tabel 4.3	Harga Saham Sektor Pertanian Tahun 2011-2015	61
Tabel 4.4	Hasil Pengujian Chow (<i>Likelihood Ratio</i>).....	65
Tabel 4.5	Hasil Pengujian Linieritas	68
Tabel 4.6	Hasil Pengujian Autokorelasi	69
Tabel 4.7	Hasil Pengujian Multikolinieritas.....	70
Tabel 4.8	Koefisien Variabel.....	72
Tabel 4.9	Keputusan Pengujian Uji t.....	75

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Rata-rata Harga Saham Sektoral tahun 2010-2014	4
Gambar 1.2	Pergerakan Harga Saham Rata-rata Tahun Subsektor yang Berada di Sektor Pertanian	5
Gambar 2.1	Kerangka Pemikiran	28
Gambar 4.1	Perkembangan Rata-rata ROA SektorPertanian tahun 2010-2014	57
Gambar 4.2	Perkembangan Rata-rata ROE SektorPertanian tahun 2010-2014	60
Gambar 4.3	Perkembangan Rata-rata Harga Saham tahun 2011-2015.....	64
Gambar 4.4	Hasil Pengujian Normalitas	66
Gambar 4.5	Hasil Pengujian Normalitas	67
Gambar 4.6	Hasil Pengujian Heteroskedastisitas	71

DAFTAR LAMPIRAN

- I. Tabulasi Data Penelitian
- II. Tabel Durbin Watson
- III. Tabel Distribusi F
- IV. Tabel Distribusi t
- V. Frekuensi Bimbingan
- VI. Surat Keterangan Judul Skripsi dan Penetapan Dosen Pembimbing Skripsi
- VII. Surat Keterangan Perubahan Judul
- VIII. Lembar Evaluasi Presentasi Rancangan Usul Penelitian untuk Skripsi
- IX. Riwayat Hidup Penulis