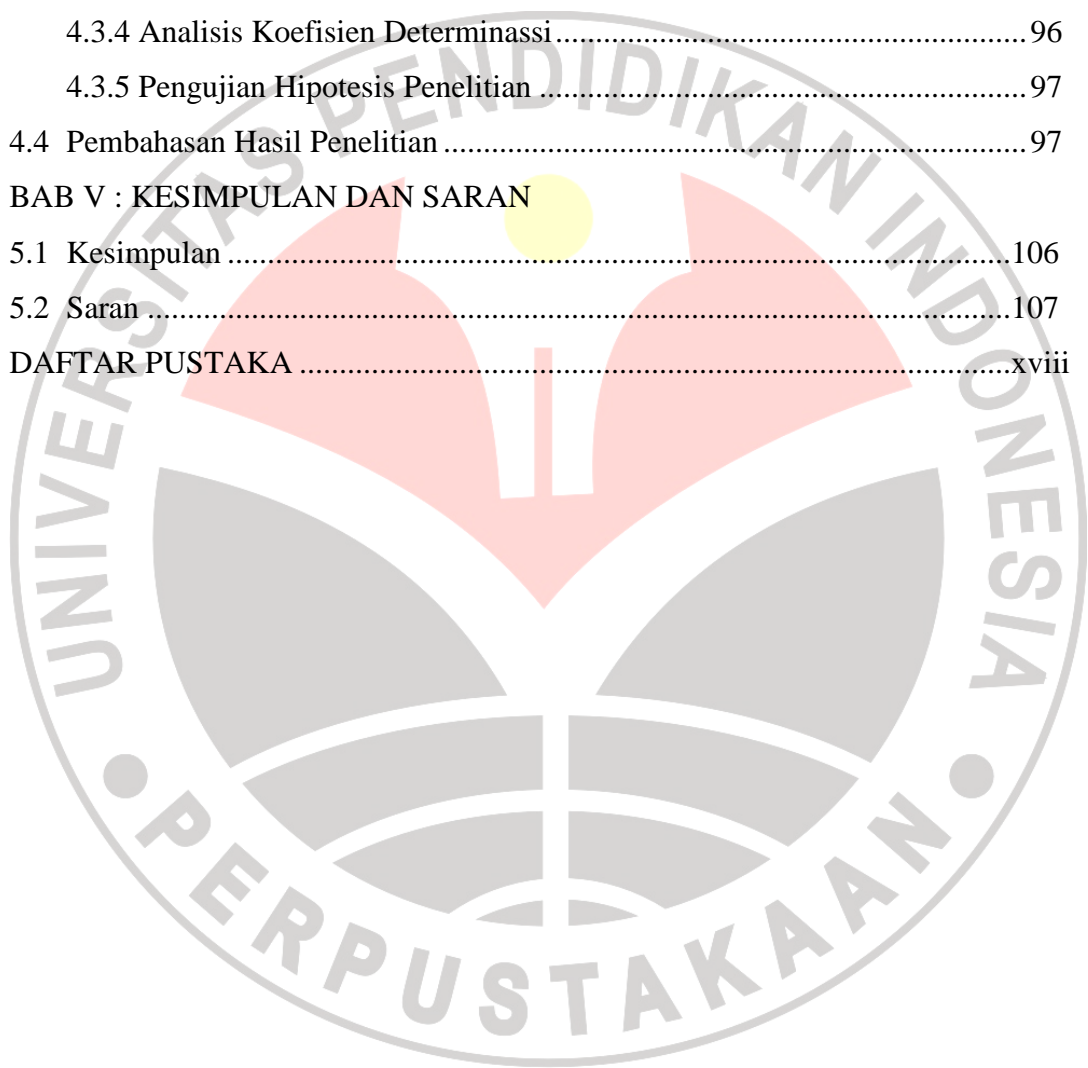


## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Hak Cipta.....	ii
Lembar Pengesahan.....	iii
Motto dan Persembahan.....	iv
Lembar Pernyataan.....	v
Abstrak.....	vi
Abstract.....	vii
Kata Pengantar.....	viii
Daftar Isi.....	xii
Daftar Tabel.....	xv
Daftar Gambar.....	xvi
Daftar Lampiran.....	xvii
<b>BAB I : PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Identifikasi dan Rumusan masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Kegunaan Penelitian.....	8
<b>BAB II : KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS</b>	
2.1 Kajian Pustaka.....	9
2.1.1 Investasi.....	9
2.1.1.1 Pengertian Investasi.....	9
2.1.1.2 Tujuan Investasi.....	10
2.1.1.3 Dasar Keputusan Investasi.....	11
2.1.2 Pengertian Pasar Modal.....	12
2.1.2.1 Peranan pasar modal.....	14

2.1.2.2 Instrumen pasar modal .....	16
2.1.3 Definisi Saham .....	18
2.1.3.1 Jenis-jenis saham.....	19
2.1.3.2 Indeks Harga Saham.....	22
2.1.4 Kinerja Keuangan .....	24
2.1.4.1 Kinerja Profitabilitas .....	28
2.1.4.1.1 Return On Assets (ROA).....	29
2.1.4.1.2 Return On Equity (ROE).....	31
2.1.5 Analisis Harga Saham .....	33
2.1.5.1 Harga Saham .....	33
2.1.5.2 Return Saham .....	36
2.1.6 Hubungan rasio profitabilitas terhadap <i>return</i> saham .....	39
2.1.7 Tinjauan penelitian terdahulu .....	40
2.2 Kerangka Pemikiran.....	41
2.3 Hipotesis .....	46
<b>BAB III : METODE PENELITIAN</b>	
3.1 Objek penelitian .....	47
3.2 Metode dan Desain penelitian.....	48
3.3 Operasionalisasi Variabel .....	49
3.4 Jenis, Sumber, dan Teknik Pengumpulan Data .....	51
3.5 Populasi, Sampel dan Teknik penarikan sampel.....	52
3.6 Rancangan Analisis Data .....	55
3.6.1 Metode Pengukuran Variabel.....	55
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	66
3.6.3 Analisis Regresi Linier Sederhana.....	60
3.6.4 Analisis Korelasi .....	61
3.6.5 Analisis Koefisien Determinasi .....	64
3.6.6 Pengujian Hipotesis .....	65
<b>BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b>	
4.1 Gambaran Objek Penelitian .....	66
4.2 Deskripsi Data Variabel Penelitian .....	75

4.2.1 Profitabilitas .....	75
4.2.2 Return saham .....	81
4.3 Pengujian Hipotesis Penelitian .....	86
4.3.1 Pengujian Asumsi Klasik .....	86
4.3.2 Analisis Regresi Linier Sederhana .....	92
4.3.3 Analisis korelasi <i>Product Moment</i> .....	94
4.3.4 Analisis Koefisien Determinasi .....	96
4.3.5 Pengujian Hipotesis Penelitian .....	97
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian .....	97
<b>BAB V : KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
5.1 Kesimpulan .....	106
5.2 Saran .....	107
DAFTAR PUSTAKA .....	xviii



## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Operasioanlisasi Variabel .....	50
Tabel 3.2 Jenis dan Sumber Data.....	51
Tabel 3.3 Populasi Penelitian.....	53
Tabel 3.4 Sampel Penelitian.....	54
Tabel 3.5 Pedoman Intepretasi Korelasi <i>Pearson</i> .....	62
Tabel 3.6 Kriteria R square .....	64
Tabel 4.1 Daftar emiten <i>retail</i> objek penelitian .....	66
Tabel 4.2 Perhitungan ROE emiten <i>retail</i> 2006-2010 .....	76
Tabel 4.3 Nilai akumulasi ROE (tanpa RIMO) tahun 2006-2010 .....	80
Tabel 4.4 Perhitungan return saham emiten retail 2006-2010 .....	82
Tabel 4.5 <i>Output</i> SPSS Uji Linearitas .....	88
Tabel 4.6 <i>Output</i> SPSS Uji Multikoliniearitas.....	89
Tabel 4.7 <i>Output</i> SPSS Uji Autokorelasi.....	90
Tabel 4.8 Kriteria pengujian Autokorelasi.....	90
Tabel 4.9 <i>Output</i> SPSS Model Regresi.....	93
Tabel 4.10 <i>Output</i> SPSS korelasi <i>product moment</i> .....	95
Tabel 4.11 <i>Output</i> SPSS koefisien determinasi .....	96

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Return saham emiten subsektor <i>retail</i> 2006-2010.....	3
Gambar 1.2 Kinerja Profitabilitas emiten <i>retail</i> 2006-2010 .....	4
Gambar 2.1 Kerangka pemikiran .....	45
Gambar 2.2 Paradigma penelitian.....	45
Gambar 4.1 Gambaran Kinerja ROE emiten <i>retail</i> 2006-2010 .....	77
Gambar 4.2 Gambaran Return saham emiten <i>retail</i> 2006-2010 .....	84
Gambar 4.3 Grafik sebar Uji normalitas <i>P-P Plot regression residual</i> .....	87
Gambar 4.4 Grafik Sebar pengujian Heterokedastisitas .....	92

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Dokumen Penelitian .....	xxii
Lampiran 2 : Laporan Keuangan (Audit) emiten subsektor <i>retail</i> 2006-2010....	xxiii
Lampiran 3 : Perhitungan Manual variabel penelitian.....	xxiv
Lampiran 4 : <i>Output</i> SPSS 15 <i>For Windows</i> .....	xxv
Lampiran 5 : Catatan Riwayat Hidup.....	xxvi

