

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING	iv
HALAMAN PENGESAHAN REVISI SKRIPSI	v
SURAT PERNYATAAN.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
ABSTRAK.....	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB 1.....	1
PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	9
1.3 Batasan Masalah	10
1.4 Perumusan Masalah	10
1.5 Tujuan Penelitian	11
1.6 Manfaat Penelitian	11
1.6.1 Manfaat Teoritis	12
1.6.2 Manfaat Praktis.....	12
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	14
2.1 Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	14
2.2 Manajemen Keuangan	14
2.3 Investasi	15
2.4 Risiko Investasi.....	16
2.5 Saham	17

2.5.1	Jenis Saham	17
2.5.2	Beta Saham.....	19
2.5.3	Beta Sebagai Ukuran Risiko Sistematis	20
2.5.4	Pengukuran Beta Saham.....	21
2.6	Faktor Fundamental	23
2.6.1	<i>Return on Asset</i> (ROA).....	24
2.6.2	<i>Return on Equity</i> (ROE).....	24
2.6.3	<i>Asset Growth</i> (AG).....	25
2.6.4	<i>Earning per Share</i> (EPS).....	26
2.7	Hasil Penelitian Terdahulu.....	27
2.8	Kerangka Pemikiran	35
2.9	Hipotesis Penelitian	35
2.9.1	Pengaruh <i>Return On Asset</i> (ROA) terhadap Beta Saham.....	35
2.9.2	Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) terhadap Beta Saham.....	36
2.9.3	Pengaruh <i>Asset Growth</i> (AG) terhadap Beta Saham.....	37
2.9.4	Pengaruh <i>Earnings per Share</i> (EPS) terhadap Beta Saham	37
2.9.5	Pengaruh <i>Return on Asset</i> (ROA), <i>Return on Equity</i> (ROE), <i>Asset Growth</i> (AG), dan <i>Earning per Share</i> (EPS) terhadap Beta Saham.....	38
BAB 3	METODOLOGI PENELITIAN	40
3.1	Desain Penelitian	40
3.2	Lokasi dan Waktu Penelitian	40
3.3	Definisi Operasional Variabel	41
3.3.1	Variabel <i>Dependen</i>	41
3.3.2	Variabel <i>Independen</i>	42
3.3.2.1	<i>Return on Asset</i> (ROA) (X_1)	42
3.3.2.2	<i>Return on Equity</i> (ROE) (X_2).....	42
3.3.2.3	<i>Asset Growth</i> (AG) (X_3).....	43
3.3.2.4	<i>Earning per Share</i> (EPS) (X_4)	43
3.4	Populasi, Sampel dan Teknik Sampling	45
3.4.1	Populasi Penelitian	45
3.4.2	Sampel Penelitian	45

3.4.3	Teknik Sampling	46
3.5	Pengumpulan Data Penelitian	47
3.5.1	Sumber Data Penelitian	47
3.5.2	Teknik Pengumpulan Data	48
3.5.3	Instrumen Penelitian	48
3.6	Rancangan Analisis	48
3.7	Analisis Data	49
3.7.1	Analisis Statistik Deskriptif	49
3.7.2	Uji Asumsi Klasik	49
3.7.2.1	Uji Normalitas	49
3.7.2.2	Uji Multikolinearitas	49
3.7.2.3	Uji Autokorelasi	50
3.7.2.4	Uji Heteroskedastisitas	51
3.7.3	Analisis Regresi Linear Sederhana	51
3.7.4	Analisis Regresi Linear Berganda	52
3.7.5	Uji Hipotesis	53
3.7.5.1	Uji Parsial (Uji Statistik t)	53
3.7.5.2	Uji Signifikan Simultan (uji F)	54
3.7.5.3	Koefisien Determinasi (R^2)	55
BAB 4	HASIL DAN PEMBAHASAN	56
4.1	Hasil Penelitian	56
4.1.1	Profil Lokus atau Objek Penelitian	56
4.1.2	Analisis Deskriptif	59
4.1.3	Hasil Uji Asumsi Klasik	63
4.1.3.1	Uji Normalitas	63
4.1.3.2	Uji Multikolinearitas	64
4.1.3.3	Uji Autokorelasi	65
4.1.3.4	Uji Heteroskedastisitas	65
4.1.4	Analisis Regresi Linear Sederhana	66

4.1.5	Analisis Regresi Linear Berganda	69
4.1.6	Uji Hipotesis	71
4.1.6.1	Uji Parsial (Uji t)	71
4.1.6.2	Uji Pengaruh Simultan (Uji F)	73
4.1.6.3	Koefisien Determinasi (R^2)	74
4.2	Pembahasan Penelitian	74
4.2.1	Pengaruh <i>Return on Asset</i> (ROA) Terhadap Beta Saham	75
4.2.2	Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) Terhadap Beta Saham	76
4.2.3	Pengaruh <i>Asset Growth</i> Terhadap Beta Saham	78
4.2.4	Pengaruh <i>Earning per Share</i> (EPS) Terhadap Beta Saham	79
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN	81
5.1	Kesimpulan dan Implikasi	81
5.1.1	Kesimpulan	81
5.1.2	Implikasi	81
5.2	Keterbatasan dan Saran	82
5.2.1	Keterbatasan	82
5.2.2	Saran	83
DAFTAR PUSTAKA		84



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Perbandingan Penelitian Terdahulu Dengan Penelitian Sekarang	27
Tabel 3.1 Kriteria Penilaian Beta	42
Tabel 3.2 Definisi Operasional dan Skala Pengukuran Variabel	43
Tabel 3.3 Hasil <i>Purposive Sampling</i>	46
Tabel 3.4 Tabel Pengambilan Keputusan Uji Autokorelasi	50
Tabel 4.1 Kriteria Pemilihan Sampel	57
Tabel 4.2 Daftar Perusahaan Sampel	58
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif.....	60
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas.....	63
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas	64
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokolerasi.....	65
Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas	66
Tabel 4.8 Hasil Regresi Linear Sederhana $X_1 - Y$	66
Tabel 4.9 Hasil Regresi Linear Sederhana $X_2 - Y$	67
Tabel 4.10 Hasil Regresi Linear Sederhana $X_3 - Y$	68
Tabel 4.11 Hasil Regresi Linear Sederhana $X_4 - Y$	68
Tabel 4.12 Hasil Regresi Linear Berganda.....	69
Tabel 4.13 Hasil Uji Parsial	71
Tabel 4.14 Hasil Uji Pengaruh Simultan.....	73
Tabel 4.15 Hasil Koefisien Determinasi (R^2)	74

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Perkembangan Saham Properti, Perumahan dan Konstruksi	4
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	35



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Tabel t	88
Lampiran 2 Tabel F	91
Lampiran 3 Tabel Durbin-Watson (DW)	92
Lampiran 4 Hasil Output SPSS versi 25 Analisis Regresi Linear Sederhana	93
Lampiran 5 Hasil Output SPSS versi 25 Analisis Regresi Linear Berganda	95
Lampiran 6 Kartu Bimbingan Skripsi Pembimbing 1.....	97
Lampiran 7 Koreksi Bimbingan Skripsi Pembimbing 1	98
Lampiran 8 Kartu Bimbingan Skripsi Pembimbing 2.....	99
Lampiran 9 Koreksi Bimbingan Skripsi Pembimbing 2	100
Lampiran 10 Form Permohonan Pengecekan Turnitin	104
Lampiran 11 Hasil Turnitin	105
Lampiran 12 SKPI.....	118
Lampiran 13 Biodata Diri.....	125

