

## DAFTAR ISI

|   |      |
|---|------|
| HALAMAN JUDUL .....                       | i    |
| HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI.....           | ii   |
| HALAMAN PERSEMBAHAN DAN MOTTO.....        | iii  |
| HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI ..... | v    |
| KATA PENGANTAR .....                      | vi   |
| DAFTAR ISI .....                          | viii |
| DAFTAR TABEL .....                        | xi   |
| DAFTAR GAMBAR .....                       | xii  |
| DAFTAR LAMPIRAN .....                     | xiii |
| ABSTRAKSI .....                           | xiv  |
| <b>BAB I      PENDAHULUAN</b>             |      |
| 1.1. Latar Belakang Masalah .....         | 1    |
| 1.2. Rumusan Masalah .....                | 10   |
| 1.3. Tujuan Penelitian .....              | 11   |
| 1.4. Manfaat Penelitian .....             | 12   |
| <b>BAB II     KAJIAN PUSTAKA</b>          |      |
| 2.1. Landasan Teori .....                 | 13   |
| 2.1.1. Investasi .....                    | 13   |
| 2.1.2. Analisis Fundamental .....         | 14   |
| 2.1.3. Laporan Keuangan .....             | 14   |
| 2.1.4. Rasio Keuangan .....               | 15   |

|         |   |    |
|---------|---|----|
| 2.1.5.  | Harga Saham .....                             | 16 |
| 2.1.6.  | Indeks Saham Kompas 100 .....                 | 17 |
| 2.2.    | Variabel-variabel penelitian dan pengembangan |    |
|         | Hipotesis .....                               | 19 |
| 2.3.    | Model Empirik .....                           | 27 |
| <br>    |   |    |
| BAB III | METODE PENELITIAN                             |    |
| 3.1.    | Jenis Penelitian .....                        | 28 |
| 3.2.    | Populasi dan Sampel .....                     | 29 |
| 3.3.    | Jenis dan Sumber Data .....                   | 30 |
| 3.4.    | Teknik Pengumpulan Data .....                 | 31 |
| 3.5.    | Definisi Operasional .....                    | 31 |
| 3.6.    | Metode Analisis Data .....                    | 32 |
| <br>    |   |    |
| BAB IV  | HASIL DAN PEMBAHASAN                          |    |
| 4.1.    | Statistik Deskriptif .....                    | 40 |
| 4.2.    | Penentuan Model Estimasi Data Panel .....     | 42 |
| 4.3.    | Penentuan Motode Estimasi .....               | 43 |
| 4.4.    | Uji Asumsi Klasik .....                       | 45 |
| 4.5.    | Pembahasan .....                              | 52 |
| <br>    |   |    |
| BAB V   | PENUTUP                                       |    |
| 5.1.    | Simpulan .....                                | 59 |
| 5.2.    | Keterbatasan Penelitian .....                 | 59 |
| 5.3.    | Agenda Penelitian Mendatang .....             | 60 |

|                      |    |
|----------------------|----|
| 5.4. Saran .....     | 61 |
| DAFTAR PUSTAKA ..... | 63 |
| LAMPIRAN             |    |

## DAFTAR TABEL

|   |    |
|---|----|
| Tabel 1.1 Riset GAP .....                                       | 7  |
| Tabel 3.1 Definisi Operasional .....                            | 31 |
| Tabel 3.2 Pengambilan Keputusan Ada Tidaknya Autokorelasi ..... | 35 |
| Tabel 4.1 Kriteria Dalam Penentuan Sampel .....                 | 39 |
| Tabel 4.2 Statistik Deskriptif .....                            | 40 |
| Tabel 4.6 Uji <i>Chow</i> .....                                 | 43 |
| Tabel 4.7 Uji <i>Hausman</i> .....                              | 44 |
| Tabel 4.8 Uji Multikolinearitas .....                           | 46 |
| Tabel 4.9 Uji Autokorelasi .....                                | 47 |
| Tabel 4.10 Hasil Uji <i>Glejser</i> .....                       | 48 |
| Tabel 4.11 Hasil Analisis Regresi .....                         | 49 |

## DAFTAR GAMBAR

|  |    |
|--|----|
| Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran .....    | 27 |
| Gambar 4.1 Grafik Uji Normalitas ..... | 45 |

## DAFTAR LAMPIRAN

|  |    |
|--|----|
| Daftar Penelitian Terdahulu .....              | 1  |
| Tabulasi Data .....                            | 8  |
| <i>Output</i> Deskriptif Statistik .....       | 12 |
| <i>Output</i> Model <i>Common Effect</i> ..... | 12 |
| <i>Output</i> Model <i>Fixed Effect</i> .....  | 13 |
| <i>Output</i> Model <i>Random Effect</i> ..... | 14 |
| <i>Output</i> Uji <i>Chow</i> .....            | 15 |
| <i>Output</i> Uji <i>Hausman</i> .....         | 16 |
| <i>Output</i> Uji Multikolinearitas .....      | 17 |
| <i>Output</i> Uji Autokorelasi .....           | 17 |
| <i>Output</i> Uji Glejser .....                | 18 |