

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAKSI	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
DAFTAR SINGKATAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	9
1.5 Sistematika Penulisan	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Perusahaan sektor Barang Konsumsi di Indonesia	11
2.1.1 Subsektor Makanan & Minuman	12
2.1.2 Subsektor Rokok	12
2.1.3 Subsektor Farmasi	13
2.1.4 Subsektor Kosmetik & Keperluan Rumah Tangga	14
2.1.5 Subsektor Peralatan Rumah Tangga	15
2.2 <i>Return</i> Saham	16
2.3 Makro Ekonomi	17
2.3.1 Laju Inflasi	18
2.3.2 PDB	19
2.3.3 <i>Return</i> Pasar	22
2.4 Penelitian Terdahulu	22

BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	24
	3.1 Pendekatan Penelitian	24
	3.2 Objek Penelitian	24
	3.3 Jenis & Sumber Data	27
	3.4 Populasi & Sampel	27
	3.4.1 Populasi	27
	3.4.2 Sampel	27
	3.5 Definisi Operasional & Pengukuran variabel	29
	3.5.1 Variabel Dependen	29
	3.5.2 Variabel Independen	30
	3.6 Metode Pengumpulan Data	31
	3.6.1 Penelitian dengan Pustaka	31
	3.6.2 Dokumentasi	31
	3.7 Metode Analisis Data	32
	3.7.1 Analisis Kuantitatif	32
	3.7.1.1 Uji Normalitas	32
	3.7.1.2 Uji Multikolinearitas	32
	3.7.1.3 Uji Autokorelasi	32
	3.7.1.4 Uji Heteroskedastisitas	33
	3.7.1.5 Uji Regresi Linear Berganda	34
	3.7.1.6 Uji Hipotesis	34
	3.8 Kerangka Penelitian	35
	3.8.1 Kerangka Konseptual Penelitian	36
BAB IV	ANALISA & PEMBAHASAN	38
	4.1 Gambaran Umum Industri	38
	4.2 Return Saham Industri Barang Konsumsi	39
	4.3 Perkembangan Makro Ekonomi di Indonesia	40
	4.3.1 Laju Inflasi	40
	4.3.2 Produk Domestik Bruto (PDB)	41
	4.3.3 Return Pasar Modal (IHSG)	42
	4.4 Analisis Data Kuantitatif	43
	4.4.1 Uji Normalitas	43
	4.4.2 Uji Multikolinearitas	45
	4.4.3 Uji Autokorelasi	45
	4.4.4 Uji Heteroskedastisitas	47

	4.4.5 Uji Regresi Linear Berganda	48
	4.4.6 Uji Hipotesis	48
	4.5 Kesimpulan Analisis	52
	4.6 Pembahasan Hasil Penelitian	54
BAB V	PENUTUP	56
	5.1 Kesimpulan	56
	5.2 Saran	57
	DAFTAR PUSTAKA	58
	LAMPIRAN	65

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Return Saham perusahaan Barang Konsumsi 2013-2015	4
Tabel 4.1 Uji Normalitas Kolmogorov-Smirnov	43
Tabel 4.2 Uji Multikolinearitas variabel independen	45
Tabel 4.3 Uji Autokorelasi <i>Return</i> Saham perusahaan barang konsumsi	45
Tabel 4.4 Uji Heteroskedastisitas	47
Tabel 4.5 Output SPSS Regresi Linear Berganda	48
Tabel 4.6 Output SPSS Uji F	50
Tabel 4.7 Output SPSS R Square	70
Tabel 4.8 Output SPSS Uji Hipotesis Parsial	51
Tabel 4.9 Hasil Analisis Penelitian	52
Tabel 5.1 Kesimpulan Hasil Analisis Penelitian	56

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 3.1 Kerangka Konseptual Penelitian	36
Gambar 4.1 Rata – rata <i>Return</i> Saham Perusahaan sektor Barang Konsumsi	39
Gambar 4.2 Data Laju Inflasi 2008 – 2015	40
Gambar 4.3 Data Pertumbuhan PDB 2008 – 2015	41
Gambar 4.4 Tingkat Keuntungan (<i>return</i>) IHSG 2008 – 2015	42
Gambar 4.5 Kerangka Konseptual	43
Gambar 4.6 Histogram Return Saham Perusahaan Barang konsumsi	44
Gambar 4.7 Uji P-Plot Return Saham Perusahaan Barang konsumsi	44

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 : <i>Return</i> Saham Perusahaan sektor Barang Konsumsi (sampel penelitian) 2008 – 2015.	65
Lampiran 2 : Data Inflasi Triwulanan Olahan Penulis	66
Lampiran 3: Data Tingkat Inflasi Bulanan	67
Lampiran 4: Data Pertumbuhan PDB Menurut Pengeluaran atas dasar Harga Konstan tahun 2000	68
Lampiran 5: Data Harga IHSG 2008 – 2015	69
Lampiran 6: Data Input SPSS Variabel Independen	70
Lampiran 7: Hasil Uji Normalitas dengan SPSS 23	71
Lampiran 8: Hasil Uji Multikolinearitas dengan SPSS 23	73
Lampiran 9: Hasil Uji Autokorelasi dengan SPSS 23	73
Lampiran 10: Hasil Uji Heteroskedastisitas dengan SPSS 23	73
Lampiran 11: Hasil Uji Regresi Linear Berganda	74
Lampiran 12: Hasil Analisis Data	75
Lampiran 13: Hasil Analisis Penelitian	75

DAFTAR SINGKATAN

BEI	: Bursa Efek Indonesia
BI	: Bank Indonesia
BPS	: Badan Pusat Statistik
IHSG	: Indeks Harga Saham Gabungan
PDB	: Produk Domestik Bruto
AISA	: PT Tiga Pilar Sejahtera Food Tbk
CEKA	: PT Wilmar Cahaya Indonesia Tbk
DLTA	: PT Delta Djakarta Tbk
INDF	: PT Indofood Sukses Makmur Tbk
MLBI	: PT Multi Bintang Indonesia Tbk
MYOR	: PT Mayora Indah Tbk
PSDN	: PT Prashida Aneka Niaga Tbk
STTP	: PT Siantar Top Tbk
ULTJ	: PT Ultrajaya Milk Industry and Trading Company Tbk
DVLA	: PT Darya Varia Laboratoria Tbk
INAF	: PT Indofarma Tbk
KAEF	: PT Kimia Farma Tbk
KLBF	: PT Kalbe Farma Tbk
PYFA	: PT Pyridam Farma Tbk
TSPC	: PT Tempo Scan Pasific Tbk
ADES	: PT Akasha Wira International Tbk
TCID	: PT Mandom Indonesia Tbk

UNVR : PT Unilever Indonesia Tbk
KICI : PT Kedaung Indah Can Tbk
LMPI : PT Langgeng Makmur Industry Tbk
GGRM : PT Gudang Garam Tbk
HMSP : PT Handjaya Mandala Sampoerna Tbk
RMBA : PT Bentoel International Investama Tbk
N : Terdistribusi Normal
TN : Tidak Terdistribusi Normal
M : Terjadi Multikolinearitas
TM : Tidak Terjadi Multikolinearitas
A : Terjadi Autokorelasi
TA : Tidak Terjadi Autokorelasi
TH : Tidak Terjadi Heterokedastisitas
S : Berpengaruh Signifikan
TS : Tidak Berpengaruh Signifikan