

Penulis menyadari bahwa naskah penelitian ini masih jauh dari kata sempurna. Oleh karena itu, kritik dan saran yang membangun senantiasa penulis harapkan untuk motivasi juga demi kemajuan di masa mendatang.

Akhir kata penulis ucapkan semoga Allah SWT senantiasa melimpahkan karunia-Nya atas semua amal kebaikan serta memberikan berkah, rahmat dan hidayah-Nya.

Wassalamu'alaikum Wr.Wb.

Tasikmalaya, Maret 2022

Penulis

Fauziah Islamiati Sudrajat

DAFTAR ISI

LEMBAR.....	i
PERNYATAAN.....	ii
ABSTRACT.....	iii
ABSTRAK.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	24
1.3 Tujuan Penelitian	24
1.4 Kegunaan Penelitian.....	25
1.5 Lokasi dan Jadwal Penelitian	25
1.5.1 Lokasi Penelitian	25
1.5.2 Jadwal Penelitian.....	26
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS.....	27
2.1 Tinjauan Pustaka	27
2.1.1 <i>Price Earning Ratio</i>	27
2.1.1.1 Pengertian Price Earning Ratio	27
2.1.1.2 Kegunaan dan Manfaat Price Earning Ratio	28
2.1.1.3 Pengukuran Price Earning Ratio	28
2.1.2 <i>Dividend Yield</i>	29
2.1.2.1 Pengertian Dividend Yield.....	29
2.1.2.2 Pengukuran Dividend Yield.....	30
2.1.3 <i>Sales Growth</i>	31
2.1.3.1 Pengertian Sales Growth.....	31
2.1.3.2 Pengukuran Sales Growth.....	32
2.1.4 <i>Return Saham</i>	32
2.1.4.1 Pengertian Return Saham.....	32

2.1.4.2	Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Return Saham	33
2.1.4.3	Jenis-Jenis Return Saham.....	36
2.1.4.4	Komponen Return Saham	37
2.1.4.5	Pengukuran Return Saham.....	38
2.2	Kerangka Pemikiran.....	39
2.3	Hipotesis	46
BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN.....		47
3.1	Objek Penelitian.....	47
3.1.1	Gambaran Umum Perusahaan Manufaktur	47
3.1.2	Gambaran Umum Perusahaan Sektor <i>Consumer Goods Industry</i> yang Menjadi Sampel.....	48
3.2	Metode Penelitian.....	65
3.2.1	Operasionalisasi Variabel	66
3.2.2	Teknik Pengumpulan Data	68
3.2.2.1	Jenis Data.....	68
3.2.2.2	Populasi Sasaran	69
3.2.2.3	Penentuan Sampel.....	73
3.2.2.4	Prosedur Pengumpulan Data.....	75
3.3	Model atau Paradigma Penelitian	75
3.4	Teknik Analisis Data.....	77
3.4.1	Metode Analisis Data	77
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		87
4.1	Hasil Penelitian	87
4.1.1.1	Price Earning Ratio Pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020	87
4.1.1.2	Dividend Yield pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020	89
4.1.1.3	Sales Growth pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020.....	90
4.1.1.4	Return Saham pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020.....	91
4.1.1	Uji Asumsi Klasik	92
4.1.2.1	Uji Multikolonieritas.....	92

4.1.2.2 Uji Heterokedastisitas	93
4.1.2.3 Uji Autokorelasi.....	94
4.1.2 Statistika Deskriptif	95
4.1.3 Analisis Regresi Data Panel.....	96
4.1.4.1 Pemilihan Model Estimasi Regresi Data Panel	96
4.1.4.2 Hasil Regresi Data Panel.....	98
4.1.4 Koefisien Determinasi (R ²).....	99
4.1.5 Uji Signifikansi.....	99
4.1.6.1 Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t).....	99
4.1.6.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	100
4.2 Pembahasan.....	101
4.2.1 <i>Price Earning Ratio (PER), Dividend Yield, dan Sales Growth</i> pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	101
4.2.1.1 Price Earning Ratio pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020	101
4.2.1.2 <i>Dividend Yield</i> pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i>	104
4.2.1.3 Sales Growth pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020.....	106
4.2.1.4 Return Saham pada Perusahaan Consumer Goods Industry 2016-2020.....	109
4.2.2 Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i> pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	111
4.2.3 Pengaruh <i>Dividend Yield</i> Terhadap <i>Return Saham</i> pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020.....	114
4.2.4 Pengaruh <i>Sales Growth</i> Terhadap <i>Return Saham</i> pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020.....	116
4.2.5 Pengaruh <i>Price Earning Ratio, Dividend Yield, dan Sales Growth</i> Terhadap <i>Return Saham</i> Secara Bersama-Sama pada Perusahaan <i>Consumer</i> <i>Goods Industry</i> 2016-2020	119
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	120
5.1 Simpulan	120
5.2 Saran	122
DAFTAR PUSTAKA	125
DAFTAR LAMPIRAN	133

DAFTAR TABEL

Nomor	Nama Tabel	Halaman:
1.1	Perbedaan dan Persamaan Penelitian Terdahulu dengan Rencana Penelitian Penulis	19
3.1	Operasionalisasi Variabel Penelitian	72
3.2	Populasi Penelitian	75
3.3	Sampel Penelitian	79
4.1	Price Earning Ratio Pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	91
4.2	Dividend Yield Pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	92
4.3	Sales Growth Pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	93
4.4	Return Saham Pada Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i> 2016-2020	95
4.5	Uji Multikolinearitas	96
4.6	Uji Heterokedasitas	97
4.7	Uji Autokorelasi	98
4.8	Uji Statistika Deskriptif	98
4.9	Uji Chow	100
4.10	Uji Hausman	97

4.11	Uji Lagrange Multiplier	100
4.12	Uji Signifikansi Parsial	103
4.13	Uji Signifikansi Simultan.....	104

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Nama Gambar	Halaman:
1.4	<i>Idx quartley Statistics, 4th Quarter 2020 Consumer Goods Indutry</i>	
	2019 – 2020	3
1.5	Harga Saham Perusahaan <i>Consumer Goods Industry</i>	4
2.1	Kerangka Pemikiran	48
3.1	Paradigma Penelitian.....	79