

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Identifikasi dan Pembatasan Masalah.....	10
1.2.1 Identifikasi Masalah.....	10
1.2.2 Pembatasan Masalah.....	11
1.3 Perumusan Masalah.....	11
1.4 Tujuan Penelitian.....	12
1.5 Manfaat Penelitian.....	12
BAB II LANDASAN TEORI	14
2.1 Tinjauan Teori.....	14
2.1.1 Teori Sinyal.....	14
2.1.2 Teori Struktur Modal.....	16
2.1.3 Value Relevance.....	17
2.1.3.1 Pengertian Value Relevance.....	17
2.1.3.2 Tujuan Value Relevance.....	17

2.1.4	Laporan Keuangan.....	18
2.1.4.1	Pengertian Laporan Keuangan.....	18
2.1.4.2	Tujuan Laporan Keuangan	19
2.1.4.3	Susunan Laporan Keuangan.....	20
2.1.5	<i>Return</i> Saham	20
2.1.5.1	Pengertian <i>Return</i> Saham	20
2.1.5.2	Jenis-Jenis <i>Return</i> Saham	21
2.1.5.3	Komponen <i>Return</i> Saham.....	21
2.1.5.4	Rumus menghitung <i>Return</i> Saham.....	21
2.1.5.5	Faktor yang mempengaruhi <i>Return</i> Saham.....	22
2.1.6	Rasio Keuangan.....	25
2.1.6.1	Pengertian Rasio Keuangan	25
2.1.6.2	Rasio Profitabilitas	25
2.1.6.3	Rasio Leverage	26
2.2	Hasil Penelitian Terdahulu	28
2.3	Hubungan Antar Variabel.....	30
2.4	Hipotesis	33
2.5	Model Penelitian.	34
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		35
3.1	Desain Penelitian.....	35
3.2	Jenis dan Sumber data	35
3.2.1	Jenis Data	35
3.2.2	Sumber Data.....	36
3.3	Populasi, Sampel, dan Teknik Pengambilan Sampel	36
3.3.1	Populasi.....	37
3.3.2	Sampel.....	38
3.3.3	Teknik Pengambilan Sampel.....	38
3.4	Unit Analisis.	39
3.5	Definisi Operasional Variabel.....	40
3.5.1	Variabel dependen	40

3.5.2	Variabel Independen	40
3.6	Teknik Analitis Data	42
3.6.1	Analisis Statistik Deskriptif	43
3.6.2	Uji Asumsi Klasik	43
3.6.2.1	Uji Normalitas	43
3.6.2.2	Uji Multikolinearitas	44
3.6.2.3	Uji Autokorelasi	44
3.6.2.4	Uji Heterokedastisitas	45
3.6.3	Uji Hipotesis	45
3.6.3.1	Uji Simultan (Uji F)	45
3.6.3.2	Uji Parsial (Uji T)	46
3.6.3.3	Uji <i>AdjustedR</i> ²	46
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	47
4.1.	Statistik Deskriptif	47
4.2.	Hasil Penelitian	48
4.2.1	Hasil Statistik Deskriptif	48
4.2.2	Hasil Uji Normalitas	50
4.2.3	Uji Asumsi Klasik	52
4.2.3.1	Uji Multikolonieritas	53
4.2.3.2	Uji Autokorelasi	54
4.2.3.3	Uji Heteroskedastisitas	56
4.2.4	Uji Regresi Linier Berganda	59
4.2.5	Uji Hipotesis	59
4.2.5.1	Uji Simultan (Uji-F)	59
4.2.5.2	Uji Parsial (Uji-t)	61
4.2.5.3	Uji Koefisien Determinasi <i>R</i> ²	63
4.3.	Pembahasan	64

4.3.1	Penaruh <i>Return On Equity</i> dan <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return</i> saham secara Simultan.....	64
4.3.2	Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return</i> Saham secara Parsial.....	64
4.3.3	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return</i> Saham secara parsial.....	65
4.4	Temuan Penelitian.....	66
4.5	Keterbatasan penelitian.....	67
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		68
5.1.	Kesimpulan	68
5.2.	Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....		71