

DAFTAR ISI

	HALAMAN
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Identifikasi Masalah	15
1.3. Pembatasan Masalah	15
1.4. Rumusan Masalah	16
1.5. Tujuan Penelitian	16
1.6. Manfaat Penelitian	17
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1. Teori Signaling.....	18
2.2. Teori Keagenan	19
2.3. Teori Relevan Akuntansi	21
2.4. <i>Return Saham</i>	22
2.4.1. Komponen Pengambilan <i>Return Saham</i>	23
2.4.2. Faktor Yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	24

2.4.3. Perhitungan <i>Return Saham</i>	25
2.5. Kinerja Perusahaan.....	26
2.5.1. <i>Current Ratio (CR)</i>	28
2.5.2. <i>Return On Asset (ROA)</i>	29
2.5.3. <i>Debt to Equity Ratio</i>	30
2.6. Nilai Tukar Rupiah (Kurs).....	31
2.6.1. Jenis-jenis Sistem Nilai Tukar yang Utama.....	32
2.7. Hasil Penelitian Sebelumnya.....	33
2.8. Hubungan Antar Variabel.....	35
2.8.1. Hubungan <i>Current Ratio (CR)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	35
2.8.2. Hubungan <i>Return On Asset (ROA)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	36
2.8.3. Hubungan <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	36
2.8.4. Hubungan Nilai Tukar Rupiah Terhadap <i>Return Saham</i>	37
2.9. Model Penelitian.....	39
2.10. Hipotesis Penelitian.....	39

BAB III METODE PENELITIAN

3.1. Desain Penelitian.....	40
3.2. Jenis dan Sumber Data.....	40
3.2.1. Jenis Data.....	40
3.2.2. Sumber Data.....	40
3.3. Populasi, Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel.....	41
3.3.1 Populasi.....	41
3.3.2 Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel.....	41
3.4. Definisi Operasional Variabel.....	43
3.4.1. Variabel Independen.....	43
3.4.1.1. Kinerja Perusahaan.....	43
3.4.1.1.1. <i>Current Ratio (CR)</i>	43
3.4.1.1.2. <i>Return On Asset (ROA)</i>	44

3.4.1.1.3. <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	44
3.4.1.2. Nilai Tukar Rupiah.....	45
3.4.2. Variabel Dependen.....	45
3.4.2.1. <i>Return Saham</i>	45
3.5. Metode Analisis Data.....	47
3.5.1. Statistik Deskriptif	47
3.5.2. Uji Normalitas	47
3.5.3. Uji Asumsi Klasik.....	48
3.5.3.1. Uji Multikolinearitas	48
3.5.3.2. Uji Autokorelasi.....	49
3.5.3.3. Uji Heteroskedastisitas.....	50
3.5.4. Analisis Regresi Berganda	51
3.5.5. Uji Hipotesis	52
3.5.5.1. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	52
3.5.5.2. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	53
3.5.5.3. Uji Koefisien Determinasi (<i>adjusted R²</i>)	54

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1. Deskriptif Objektif	55
4.2. Hasil Penelitian	55
4.2.1. Hasil Statistik Deskriptif.....	55
4.2.2. Uji Asumsi Klasik.....	58
4.2.2.1. Uji Normalitas.....	58
4.2.2.2. Uji Multikolinearitas	62
4.2.2.3. Uji Autokorelasi.....	64
4.2.2.4. Uji Heteroskedastisitas.....	65
4.2.3. Uji Regresi Berganda	67
4.2.4. Uji Hipotesis	70
4.2.4.1. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	70

4.2.4.2. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	71
4.2.4.3. Uji Koefisien Determinasi (<i>adjusted R²</i>)	73
4.3. Pembahasan Penelitian.....	74
4.4. Temuan Penelitian.....	78
4.5. Keterbatasan Penelitian.....	79
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan Penelitian	80
5.2. Saran.....	80
DAFTAR PUSTAKA	82
LAMPIRAN	84