

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAKSI	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Identifikasi dan Pembatasan Masalah	7
1.2.1 Identifikasi Masalah.....	7
1.2.2 Pembatasan Masalah.....	7
1.3. Perumusan Masalah	8
1.4. Tujuan Penelitian	9
1.5. Manfaat Penelitian... ..	9
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1. Tinjauan Teori	11
2.1.1. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	11

2.1.2. Teori Keagenan.....	13
2.1.3. Saham.....	15
2.1.4. Return Saham.....	16
2.1.5. Rasio Profitabilitas.....	18
a. Return On Assets (ROA).....	18
b. Return On Investment (ROI)	18
c. Return On Equity (ROE)	19
d. Profit Margin on Sales (NPM)	19
2.1.6. Rasio Solvabilitas.....	20
a. Debt to Assets Ratio (DAR)	20
b. Debt to Equity Ratio (DER)	20
2.1.7. Rasio Aktivitas.....	22
a. Total Asset Turn Over (TATO)	22
b. Working Capital Turn Over (WCTO)	23
c. Fixed Asset Turn Over (FATO)	23
2.1.8. Earning Per Share (EPS).....	24
2.2. Hasil Penelitian Sebelumnya.....	25
2.3. Hubungan Antar Variabel	27
2.3.1. Hubungan <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	27
2.3.2. Hubungan <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	28

2.3.3. Hubungan <i>Total Asset Turn Over</i> terhadap <i>Return Saham</i>	28
2.3.4. Hubungan <i>Earning Per Share</i> terhadap <i>Return Saham</i>	29
2.4. Hipotesis	30
2.5. Model Penelitian.....	31
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1. Desain Penelitian	32
3.2. Jenis dan Sumber Data	32
3.2.1. Jenis Data.....	32
3.2.2. Sumber Data.....	32
3.3. Populasi, Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel	33
3.3.1. Populasi.....	33
3.3.2. Sampel.....	33
3.3.3 Teknik Pengambilan Sampel.....	34
3.4. Unit Analisis	34
3.5. Definisi Operasional Variabel	34
3.6. Teknik Analisis Data	37
1. Statistik Deskriptif	38
2. Uji Kualitas Data	38
a. Uji Normalitas Data	38
3. Uji Asumsi Klasik	38
a. Uji Multikolinearitas	39

b. Uji Heteroskedastisitas	40
c. Uji Autokorelasi	40
4. Uji Regresi Linear Berganda.....	41
a. Uji Signifikasi Simultan (Uji F).....	42
b. Uji Parsial T-Test (Uji t).....	43
c. Uji Koefisien Determinasi (Adjusted R ²).....	43

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1. Hasil Penelitian	44
4.1.1. Statistik Deskriptif	44
4.1.2. Uji Kualitas Data	46
4.1.2.1. Uji Normalitas Data	46
4.1.3. Uji Asumsi Klasik	48
4.1.3.1. Uji Multikolinearitas	48
4.1.3.2. Uji Heteroskedastisitas	50
4.1.3.3. Uji Autokorelasi	51
4.1.4. Uji Regresi Linear Berganda	52
4.1.4.1. Uji Signifikasi Simultan (Uji F).....	54
4.1.4.2. Uji Parsial T-Test (Uji t).....	55
4.1.4.3. Uji Koefisien Determinasi (Adjusted R ²)...	58
4.2. Pembahasan	59
4.2.1. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	59

4.2.2. Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return</i>	
Saham.....	60
4.2.3. Pengaruh <i>Total Asset Turn Over</i> terhadap <i>Return</i>	
Saham.....	61
4.2.4. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> terhadap <i>Return</i>	
Saham.....	62
4.3. Temuan Penelitian	63
4.4. Keterbatasan Penelitian	65
BAB V SIMPULAN, SARAN DAN IMPLIKASI HASIL PENELITIAN	
5.1. Simpulan	66
5.2. Saran	67
5.3. Implikasi Hasil Penelitian	67
DAFTAR PUSTAKA	68