

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAKSI	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Identifikasi dan Perumusan Masalah.....	12
1.2.1. Identifikasi Masalah	12
1.2.2. Pembatasan Masalah	13
1.3. Rumusan Masalah	13
1.4. Tujuan Penelitian	14
1.5. Manfaat Penelitian	14
BAB II LANDASAN TEORI	16
2.1. Tinjauan Teori Terkait.....	16
2.1.1. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	16
2.1.2. <i>Arbitrage Pricing Theory</i> (APT).....	20
2.1.3. Teori Relevansi Nilai.....	21
2.1.4. Pengertian Rasio	22
2.1.5. Return Saham	30
2.1.5.1. Pengertian Return Saham.....	30

2.1.5.2. Faktor-faktor Yang Mempengaruhi Return Saham	31
2.2. Penelitian Terdahulu	37
2.2.1. Dhita Ayudia Wulandari (2009).....	37
2.2.2. Njo Anastasia	37
2.2.3. Donna Menina Della Maryanne (2009).....	38
2.2.4. Widya Pratista Wardhani (2007).....	38
2.3. Hubungan Antar Variabel.....	40
2.3.1. Hubungan Tingkat Inflasi Dengan Harga Saham	40
2.3.2. Hubungan Perubahan Kurs Dengan Harga Saham	40
2.3.3. Hubungan Tingkat Suku Bunga Dengan Harga Saham	40
2.3.4. Hubungan <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) Dengan Harga Saham	41
2.3.5. Hubungan <i>Price Earning Ratio</i> (PER) Dengan Harga Saham	42
2.3.6. Hubungan Current Ratio (CR) Dengan Harga Saham	43
2.4. Kerangka Pikir	45
2.5. Hipotesis Penelitian.....	45
BAB III METODE PENELITIAN	47
3.1. Design Penelitian	47
3.2. Jenis Data dan Sumber Data.....	47
3.2.1. Jenis Data.....	47
3.2.2. Sumber Data.....	48
3.3. Populasi dan Sampel	48
3.3.1. Populasi.....	48
3.3.2. Sampel	49
3.4. Metode Dalam Pengumpulan Data	49
3.5. Definisi Operasional Variabel	49
3.5.1. Variabel Dependen	49
3.5.2. Variabel Independen.....	50

3.6. Metode Pengolahan / Analisis Data	55
3.6.1. Metode Analisis.....	55
3.6.1.1. Uji Statistik Deskriptif	55
3.6.2. Uji Kualitas Data	55
3.6.2.1. Uji Normalitas	55
3.6.2.2. Uji Asumsi Klasik	56
3.6.3. Uji Hipotesis	58
3.6.3.1. Koefisien Determinasi (R^2)	58
3.6.3.2. Uji Regresi Linier Berganda	59
3.6.3.3. Uji Simultan	59
3.6.3.4. Uji T Parsial	60
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	61
4.1. Deskripsi Objek Penelitian	61
4.2. Hasil Penelitian	61
4.2.1. Hasil Statistik Deskriptif.....	61
4.2.2. Uji Asumsi Klasik	64
4.2.2.1. Uji Normalitas	64
4.2.2.2. Uji Multikolinearitas.....	66
4.2.2.3. Uji Heterokedastisitas	67
4.2.2.4. Uji Autokorelasi	68
4.2.3. Pengujian Hipotesis	69
4.2.3.1. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	69
4.2.3.2. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t)	70
4.2.3.3. Uji Koefisien Determinasi (Adjusted R^2)	73
4.2.3.4. Uji Regresi Linier Berganda	74
4.3. Pembahasan Penelitian	77
4.4. Temuan Penelitian.....	83

4.5. Keterbatasan Penelitian	83
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	85
5.1. Kesimpulan	85
5.2. Saran	88
DAFTAR PUSTAKA	90
LAMPIRAN	91