

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERSETUJUAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah dan Pembatasan Masalah.....	9
1.2.1 Identifikasi masalah	9
1.2.2 Pembatasan Masalah	9
1.3 Rumusan Masalah	10
1.4 Tujuan dan Manfaat Penelitian	10
1.4.1 Tujuan Penelitian	10
1.4.2 Manfaat Penelitian	11
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Tinjauan Teori.....	12
2.1.1 Value Relevance	12
2.1.2 Teori signal (signaling teory).....	13
2.2 Pengertian Laba.....	14
2.3 Laporan Keuangan	15
2.4 Saham	15
2.4.1 Pengertian Saham	15
2.4.2 Jenis- jenis Saham	16
2.5 Pasar Modal.....	17
2.6 Return Saham.....	18
2.7 Return On Aset.....	19
2.8 Debt to Equity Ratio.....	19

2.9 Ukuran perusahaan.....	20
2.10 Ratio Keuangan.....	21
2.11 Penelitian Sebelumnya.....	26
2.12 Hubungan Antar Variabel.....	27
2.13 Hipotesis.....	32
2.14 Model Penelitian.....	32
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
3.1 Desain Penelitian.....	34
3.2 Jenis dan Sumber Data.....	34
3.2.1 Jenis Data.....	34
3.2.2 Sumber Data.....	34
3.3 Populasi dan Teknik pengambilan Sampel.....	35
3.3.1 Populasi.....	35
3.3.2 Teknik Pengambilan Sampel.....	35
3.4 Operasional Variabel.....	37
3.5 Teknik Analisis Data.....	39
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	40
3.5.2 Uji Normalitas.....	40
3.5.3 Uji Asumsi Klasik.....	40
3.5.3.1 Uji Multikolinieritas.....	40
3.5.3.2 Uji Autokorelasi.....	41
3.5.3.3 Uji Heteroskedastisitas.....	42
3.5.4 Uji Hipotesis.....	42
3.5.4.1 Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	42
3.5.4.2 Uji Statistik Parameter Individual (Uji t).....	43
3.5.4.3 Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	43
3.5.4.4 Model Analisis Regresi.....	43
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1 Deskriptif Objek Penelitian.....	45
4.2 Hasil Penelitian.....	46
4.2.1 Statistik Deskriptif.....	46
4.2.2 Uji Normalitas Data.....	48
4.2.3 Uji Asumsi Klasik.....	51
4.2.3.1 Uji Multikolinieritas.....	51
4.2.3.2 Uji Autokorelasi.....	53

4.2.3.3 Uji Heteroskedastisitas	54
4.2.4 Uji Hipotesis	56
4.2.4.1 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	56
4.2.4.2 Uji Statistik Parameter Individual (Uji t)	57
4.2.4.3 Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	59
4.2.5 Persamaan Regresi.....	60
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	62
4.4 Temuan Penelitian.....	64
4.5 Keterbatasan Penelitian.....	65
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan.....	65
5.2 Saran	66
5.3 Implikasi Hasil Penelitian.....	67
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	70

DAFTAR TABEL

Nomor	Nama Tabel	Halaman
1.1	Fanomena Return Saham	3
2.1	Penelitian Sebelumnya	26
3.1	Teknik Pemilihan Sampel	36
3.2	Operasional Variabel.....	39
3.3	Uji Autokorelasi	41
4.1	Ketentuan Pemilihan Sampel	45
4.2	Daftar Perusahaan	45
4.3	Hasil Analisis Deskriptif.....	47
4.4	Hasil Uji Kolmogorof	51
4.5	Uji Multikolinearitas	52
4.6	Uji Autokorelasi	53
4.7	Uji Simultan F.....	56
4.8	Uji Signifikansi Parameter Individual.....	57
4.9	Hasil Uji Koefisien Determinasi	59
4.10	Hail Uji Analisis Regresi Linier Berganda	60

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Nama Gambar	Halaman
1.1	Perkembangan Return On Asset	5
1.2	Perkembangan Debt to Equity Ratio.....	5
1.3	Perkembangan Ukuran Perusahaan.....	6
2.1	Model Penelitian	32
4.1	Hasil Uji Normalitas sebelum di Transformasikan.....	49
4.2	Hasil Uji Normalitas sesudah di Transformasikan.....	50
4.3	Hasil Uji Heteroskedastisitas sebelum di TRanformasikan..	55
4.4	Hasil Uji Heteroskedastisitas sesudah di TRanformasikan...	55

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Nama Gambar	Halaman
1	Daftar Perusahaan yang Termasuk Dalam Sampel.....	70
2	Hasil Olahan Data.....	71
3	Hasil SPSS.....	74