

DAFTAR ISI

Cover Judul	i
Lembar Persetujuan	ii
Lembar Pengesahan	iii
Abstract	iv
Abstrak	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xii
Daftar Gambar	xiii
Daftar Lampiran	xiv

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Identifikasi Masalah dan Pembatasan Masalah	11
1.2.1 Identifikasi Masalah	11
1.2.2 Pembatasan Masalah	11
1.3 Perumusan Masalah	12
1.4 Tujuan Penelitian	13
1.5 Manfaat Penelitian	13

BAB II LANDASAN TEORI

2.1 Tinjauan Teori	15
2.1.1 Teori Signal (<i>Signalling Theory</i>)	15
2.1.2 Teori Keagenan (<i>Agency Theory</i>)	16
2.1.3 Teori Relevansi Nilai (<i>Value Relevance Theory</i>)..	17
2.1.4 <i>Return</i> Saham	18
2.1.5 Jenis-jenis <i>Return</i> Saham	19
2.1.6 Komponen <i>Return</i> Saham	20
2.1.7 Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	20
2.1.8 Rasio Likuiditas	21
2.1.9 Rasio Leverage	24
2.1.10 Rasio Aktivitas	27
2.1.11 Rasio Profitabilitas	32
2.2 Hasil Penelitian Sebelumnya	36
2.3 Hubungan Antar Variabel	39
2.4 Hipotesis Penelitian	46
2.5 Model Penelitian	47

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Desain Riset	48
3.2 Jenis dan Sumber Data	48

3.2.1	Jenis Data	48
3.2.2	Sumber Data	49
3.3	Populasi dan Sampel	50
3.3.1	Populasi	50
3.3.2	Sampel	51
3.3.3	Teknik Pengambilan Sampel	52
3.4	Unit Analisis	53
3.5	Definisi Operasional Variabel	54
3.5.1	Variabel Independen	54
3.5.2	Variabel Dependen	56
3.6	Teknik Analisis	57
3.6.1	Stastistik Deskriptif	57
3.6.2	Uji Normalitas Data.....	57
3.6.3	Asumsi Klasik	58
3.6.3.1	Uji Multikolinearitas	58
3.6.3.2	Uji Heteroskedastisitas	59
3.6.3.3	Uji Autokorelasi	59
3.6.4	Analisis Regresi Linier Berganda	61
3.6.5	Uji Hipotesis	62
3.6.5.1	Uji Signifikansi (Uji Statistik F)	62
3.6.5.2	Uji Parsial (Uji Statistik t)	62
3.6.6	Uji Determinasi (<i>Adjusted R</i> ²)	63
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1	Hasil Penelitian.....	64
4.1.1	Statistik Deskriptif	64
4.1.2	Uji Asumsi Klasik	67
4.1.2.1	Uji Normalitas Data	67
4.1.2.2	Uji Multikolinearitas	72
4.1.2.3	Uji Heteroskedastisitas	74
4.1.2.4	Uji Autokorelasi	76
4.1.3	Analisis Regresi Berganda	77
4.1.4	Uji Hipotesis	79
4.1.4.1	Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	79
4.1.4.2	Uji Signifikasi Parsial (Uji T)	80
4.1.5	Analisis Koefisien Determinasi (<i>Adjusted R</i> ²)	84
4.2	Pembahasan	85
4.2.1	Pengaruh <i>Current Ratio</i> , <i>Debt to Equity Ratio</i> , <i>Total Asset Turnover</i> , <i>Return on Equity</i>	

	terhadap <i>Return Saham</i>	85
4.2.2	Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return</i> saham ...	85
4.2.3	Pengaruh <i>Debt to Equity ratio</i> terhadap <i>return</i> saham	86
4.2.4	Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> terhadap <i>Return Saham</i>	87
4.2.5	Pengaruh <i>Return on Equity</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	88
4.3	Temuan Penelitian	89
4.4	Keterbatasan Penelitian	90
BAB IV	KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1	Kesimpulan	91
5.2	Saran	92
5.3	Implikasi Penelitian	94
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN		