

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL DEPAN SKRIPSI	1
HALAMAN JUDUL SKRIPSI.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO HIDUP	x
ABSTRAK.....	xi
ABSTRACT.....	xii
KATA PENGANTAR.....	xiii
DAFTAR ISI.....	xv
DAFTAR TABEL	xviii
DAFTAR GAMBAR.....	xix
DAFTAR LAMPIRAN	xx
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	6
BAB II KAJIAN PUSTAKA	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 Teori Perusahaan (<i>Entity Theory</i>).....	8
2.1.2 Teori Keagenan (<i>Agency Theory</i>).....	9
2.1.3 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	11
2.1.4 Analisis Rasio Keuangan	13

2.1.5 Penilaian Pasar.....	19
2.1.6 Risiko Sistematis	20
2.1.7 <i>Return</i> Saham	23
2.2 Penelitian Terdahulu.....	26
2.3 Pengembangan Hipotesis.....	31
2.3.1 Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham.....	31
2.3.2 Pengaruh Likuiditas Terhadap <i>Return</i> Saham	32
2.3.3 Pengaruh Solvabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham.....	34
2.3.4 Pengaruh Aktivitas Terhadap <i>Return</i> Saham.....	35
2.3.5 Pengaruh Penilaian Pasar Terhadap <i>Return</i> Saham	36
2.3.6 Pengaruh Risiko Sistematis Terhadap <i>Return</i> Saham.....	38
2.4 Kerangka Konsep.....	40
BAB III METODE PENELITIAN	41
3.1 Desain Penelitian	41
3.2 Tempat dan Waktu Penelitian.....	41
3.3 Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	42
3.4 Populasi dan Sampel Penelitian.....	43
3.5 Variabel Penelitian.....	45
3.6 Definisi Operasional Variabel Penelitian	46
3.7 Teknik Pengumpulan Data	52
3.8 Teknik Analisis Data	53
3.8.1 Analisis Deskriptif Statistik.....	53
3.8.2 Pengujian Asumsi Klasik	54
3.8.3 Analisis Regresi Linier Berganda	59
3.8.4 Pengujian Hipotesis	61
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	66

4.1 Deskripsi Objek Penelitian	66
4.2 Hasil Analisis Statistik Deskriptif.....	68
4.3 Hasil Pengujian Asumsi Klasik	74
4.3.1 Hasil Uji Normalitas Data.....	74
4.3.2 Hasil Uji Multikolineritas	75
4.3.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	77
4.3.4 Hasil Uji Autokorelasi	78
4.4 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda	79
4.5 Hasil Pengujian Hipotesis	83
4.5.1 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	83
4.5.2 Hasil Uji Simultan (Uji F).....	84
4.5.3 Hasil Uji Parsial (Uji T)	85
4.6 Pembahasan.....	86
4.6.1 Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return Saham</i>	86
4.6.2 Pengaruh Likuiditas terhadap <i>Return Saham</i>	87
4.6.3 Pengaruh Solvabilitas terhadap <i>Return Saham</i>	89
4.6.4 Pengaruh Aktivitas terhadap <i>Return Saham</i>	91
4.6.5 Pengaruh Penilaian Pasar terhadap <i>Return Saham</i>	92
4.6.6 Pengaruh Risiko Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	94
BAB V PENUTUP	96
5.1 Kesimpulan.....	96
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	98
5.3 Saran.....	99
5.4 Implikasi Penelitian	100
DAFTAR PUSTAKA.....	102
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	108

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	26
Tabel 4. 1 Kriteria Sampel Penelitian	67
Tabel 4. 2 Daftar Sampel Penelitian	68
Tabel 4. 3 Hasil Uji Statistik Deskriptif	69
Tabel 4. 4 Hasil Uji <i>Kolmogorov-Smirnov</i> (Uji K-S)	75
Tabel 4. 5 Hasil Uji Multikolineritas	76
Tabel 4. 6 Hasil Uji Autokorelasi	79
Tabel 4. 7 Hasil Uji Analisis Regresi Linier Berganda	79
Tabel 4. 8 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	83
Tabel 4. 9 Hasil Uji Simultan (Uji F).....	84
Tabel 4. 10 Hasil Uji Parsial (Uji T).....	85

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1 Kerangka Konsep Penelitian..... 40

Gambar 4. 1 Hasil Uji Heteroskedastisitas 77



DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 Daftar Sampel Perusahaan LQ 45 yang di Teliti.....	108
LAMPIRAN 2 Data <i>Return Saham</i>	109
LAMPIRAN 3 Data <i>Net Profit Margin</i> (NPM).....	110
LAMPIRAN 4 Data <i>Current Ratio</i> (CR)	111
LAMPIRAN 5 Data <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	112
LAMPIRAN 6 Data <i>Inventory Turn Over</i> (ITO).....	113
LAMPIRAN 7 Data <i>Price to Book Value</i> (PBV)	114
LAMPIRAN 8 Data Risiko Sistematis (<i>Beta</i>)	115
LAMPIRAN 9 Uji Statistik Deskriptif.....	116
LAMPIRAN 10 Uji Normalitas.....	117
LAMPIRAN 11 Uji Multikolineritas	118
LAMPIRAN 12 Uji Heteroskedastisitas	120
LAMPIRAN 13 Uji Autokorelasi	120
LAMPIRAN 14 Tabel <i>Durbin-Watson</i> Statistik.....	122
LAMPIRAN 15 Uji Analisis Regresi Linier Berganda.....	122
LAMPIRAN 14 Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	123
LAMPIRAN 15 Uji Simultan (Uji F)	124