

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
USULAN PENELITIAN UNTUK SKRIPSI .....	ii
USULAN PENELITIAN UNTUK SKRIPSI .....	iii
SURAT PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT.....	iii
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI .....	v
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	vi
ABSTRAK .....	vii
ABSTRACT .....	viii
INTISARI.....	ix
KATA PENGANTAR .....	x
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR .....	xvi
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1. Aspek Teoritis .....	6
2. Aspek Praktis.....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 <i>Signaling Theory</i> .....	7
2.2 Landasan Teori .....	8
2.2.1 <i>Return Saham</i> .....	8
2.2.2 Likuiditas .....	10
2.2.3 Profitabilitas .....	11
2.2.4 Solvabilitas.....	13
2.2.5 Ukuran Perusahaan.....	13
2.3 Penelitian Terdahulu.....	14
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	20

2.5	Pengembangan Hipotesis .....	22
2.5.1	Likuiditas dan <i>Return</i> Saham .....	22
2.5.2	Profitabilitas dan <i>Return</i> Saham.....	23
2.5.3	Solvabilitas dan <i>Return</i> Saham .....	24
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		26
3.1	Jenis Penelitian .....	26
3.2	Variabel, Definisi Operasional, dan Pengukuran Variabel .....	26
3.2	Populasi dan Sampel.....	28
3.4	Jenis dan Sumber Data .....	28
3.5	Teknik Pengumpulan Data .....	28
3.6	Teknik Analisis Data .....	29
3.6.1	Statistik Deskriptif.....	29
3.6.2	Metode Regresi Linier Berganda.....	29
3.6.3	Uji Asumsi Klasik .....	30
3.6.3.1	Uji Normalitas.....	30
3.6.3.2	Uji Multikolinearitas.....	31
3.6.3.3	Uji Heteroskedastisitas.....	32
3.6.3.4	Uji Autokorelasi.....	33
3.6.4	Uji Hipotesis.....	34
3.6.4.1	Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	34
3.6.4.2	Uji Statistik F .....	35
3.6.4.3	Uji Statistik t .....	36
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....		37
4.1	Deskripsi Penelitian .....	37
4.1.1	Gambaran Umum Objek Penelitian.....	37
4.2	Deskripsi Variabel.....	38
4.2.1	Hasil Uji Asumsi Klasik .....	40
4.2.1.1	Hasil Uji Normalitas .....	40
4.2.1.2	Hasil Uji Multikolonieritas .....	42
4.2.1.3	Hasil Uji Autokorelasi .....	43
4.2.1.4	Hasil Uji Heteroskedastisitas .....	44
4.2.2	Hasil Uji Hipotesis .....	46
4.2.2.1	Hasil Uji Regresi.....	47
4.2.2.2	Hasil Uji Signifikansi Simultan (Uji F) .....	49

4.2.2.3 Hasil Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	50
4.2.2.4 Hasil Uji Signifikan Parameter Individual (Uji T) .....	50
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian .....	51
4.3.1 Pengaruh CR Terhadap Return Saham.....	51
4.3.2 Pengaruh ROA Terhadap Return Saham.....	52
4.3.3 Pengaruh DER Terhadap Return Saham .....	53
BAB V PENUTUP.....	55
5.1 Kesimpulan .....	55
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	56
5.3 Saran.....	56
DAFTAR PUSTAKA .....	57
LAMPIRAN.....	59

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	15
Tabel 3.1 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel .....	27
Tabel 3.2 Pengambilan keputusan ada dan tidaknya autokorelasi .....	34
Tabel 4.1 Distribusi Sampel .....	37
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif.....	38
Tabel 4.3 Uji Statistik Kolmogorov-Smirnov (K-S) Setelah Ln.....	42
Tabel 4.4 Uji Multikolonieritas dengan Nilai Tolerance dan VIF .....	43
Tabel 4.5 Uji Autokorelasi .....	44
Tabel 4.6 Hasil Uji Glejser Setelah Ln.....	46
Tabel 4.7 Uji Regresi.....	47
Tabel 4.8 Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	49
Tabel 4.9 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	50

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran .....	22
Gambar 4.1 Grafik normal P-P Plot setelah LN.....	41
Gambar 4.2 Uji Heteroskedastisitas Dengan Grafik Scatterplot Setelah LN.....	45