

DAFTAR ISI

COVER.....	i
HALAMAN PENGESAHAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN PENGUJI	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
<i>ABSTRACT</i>	xv
ABSTRAK	xvi
INTISARI.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	11
1.4 Tujuan Penelitian.....	11
1.5 Manfaat Penelitian.....	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1 Landasan Teori.....	13
2.1.1 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	13

2.2 Variabel-variabel penelitian	16
2.2.1 <i>Return Saham</i>	16
2.2.2 <i>Solvabilitas</i>	20
2.2.3 <i>Profitabilitas</i>	27
2.2.4 <i>Aktivitas</i>	32
2.2.5 <i>Ukuran Perusahaan</i>	36
2.3 Penelitian Terdahulu	39
1. Penelitian tentang pengaruh <i>solvabilitas</i> terhadap <i>return</i> saham	39
2. Penelitian tentang pengaruh <i>profitabilitas</i> terhadap <i>return</i> saham.....	40
3. Penelitian tentang pengaruh rasio aktivitas terhadap <i>return</i> saham	41
4. Penelitian tentang pengaruh ukuran perusahaan terhadap <i>return</i> saham	42
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis dan pengembangan hipotesis	43
2.4.1 Kerangka Pemikiran Teoritis	43
2.4.2 Pengembangan Hipotesis.....	45
BAB III METODE PENELITIAN	52
3.1 Jenis Penelitian	52
3.2 Populasi dan Sampel.....	52
3.2.1 Populasi	52
3.2.2 Sampel	53
3.3 Sumber dan Jenis Data.....	53

3.4 Metode Pengumpulan Data.....	54
3.5 Variabel, Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	54
3.5.1 Variabel	54
3.5.2 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	55
3.6 Teknik Analisis Data	58
3.6.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	58
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	59
3.6.2.1 Uji Normalitas.....	59
3.6.2.2 Uji Multikolenieritas	60
3.6.2.3 Uji Autokorelasi	61
3.6.2.4 Uji Heteroskedastisitas	62
3.6.3 Analisis Regresi Linier Berganda	63
3.6.4 Uji Keباikan Model.....	64
3.6.4.1 Uji Statistik F.....	64
3.6.4.2 Koefisien Determinasi (R^2).....	65
3.6.5 Pengujian Hipotesis.....	66
3.6.5.1 Uji Parsial (Uji Statistik t)	66
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	68
4.1 Deskripsi Sampel.....	68
4.2 Statistik Deskriptif.....	69

4.3 Uji Asumsi Klasik	71
4.3.1 Uji Normalitas.....	71
4.3.2. Uji Multikolinearitas	74
4.3.3 Uji Autokorelasi.....	75
4.3.4 Uji Heteroskedastisitas	76
4.4 Hasil Regresi	78
4.4.1 Model Regresi Linier Berganda.....	78
4.5 Uji Kebaikan Model	80
4.5.1 Uji Signifikan Simultan (Uji F)	80
4.5.2 Koefisien Determinasi (R ²)	81
4.6 Pengujian Hipotesis	82
4.6.1 Uji Statistik t	82
4.7 Pembahasan Hasil Penelitian	84
4.7.1 Pengaruh <i>solvabilitas</i> terhadap <i>return</i> saham.....	84
4.7.2 Pengaruh <i>profitabilitas</i> terhadap <i>return</i> saham	85
4.7.3 Pengaruh aktivitas terhadap <i>return</i> saham	87
4.7.4 Pengaruh ukuran perusahaan terhadap <i>return</i> saham.....	88
BAB V KESIMPULAN	90
5.1 Kesimpulan.....	90
5.2 Implikasi.....	92

5.3 Keterbatasan Penelitian	93
5.4 Agenda Penelitian Mendatang	93
DAFTAR PUSTAKA	94
LAMPIRAN- LAMPIRAN	98
Lampiran 1 Daftar Sampel Perusahaan Indeks LQ-45.....	98
Lampiran 2 Hasil Tabulasi Data	99
Lampiran 3 Hasil Output SPSS 26.....	102

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Klasifikasi Ukuran Perusahaan	38
Tabel 2.2 <i>Solvabilitas</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	39
Tabel 2.3 <i>Profitabilitas</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	41
Tabel 2.4 Aktivitas Terhadap <i>Return Saham</i>	42
Tabel 2.5 Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i>	43
Tabel 3.1 Kriteria Pengambilan Keputusan Durbin-Watson	62
Tabel 4.1 Kriteria Pengambilan Sampel	68
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	69
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Sebelum Outlier	71
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas Setelah Outlier.....	72
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolonieritas	74
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi	75
Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas	76
Tabel 4.8 Model Persamaan Regresi	79
Tabel 4.9 Uji Statistik F	80
Tabel 4.10 Hasil Uji Koefisien Determinasi	81
Tabel 4.11 Hasil Uji t.....	82

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Teoritis	45
Gambar 4.1 Uji Normalitas	73
Gambar 4.2 Uji Heteroskedastisitas.....	77