

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN UJIAN	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	Error! Bookmark not defined.
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH	v
HALAMAN MOTTO	vi
KATA PENGANTAR	vii
ABSTRAK	ix
ABSTRACT.....	x
DAFTAR ISI.....	xi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	7
BAB II.....	9
TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Grand Theory.....	9
2.1.1 Teori Signal (Signaling Theory).....	9
2.1.2 Teori Keagenan.....	10
2.2 Variabel-Variabel Penelitian.....	12
2.2.1 Return Saham	12
2.2.2 Profitabilitas	13
2.2.3 Nilai Perusahaan	15
2.2.4 Ukuran Perusahaan (<i>Firm size</i>).....	17
2.3 Penelitian Terdahulu	17
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis dan Pengembangan Hipotesis	20

2.4.1	Pengaruh Profitabilitas dengan Return Saham	20
2.4.1	Pengaruh Nilai Perusahaan dengan <i>Return Saham</i>	21
2.4.3	Pengaruh <i>firm size</i> dengan <i>Return Saham</i>	22
2.5	Kerangka Penelitian	23
BAB III		25
3.1	Variabel, Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel	25
3.1.1	Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>)	26
3.1.2	Variabel Bebas (<i>Independen Variable</i>)	26
3.2	Populasi dan Sampel	31
3.2.1	Populasi	31
3.2.2	Sampel	31
3.3	Sumber dan Jenis Data	32
3.4	Metode Pengumpulan Data	33
3.5	Teknik Analisis Data	33
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif	34
3.5.2	Uji Asumsi Klasik	34
3.5.3	Analisis Regresi Linear Berganda	37
3.5.4	Uji Kebaikan Model (<i>Goodness Of Fit</i>)	37
BAB IV		41
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		41
4.1	Deskripsi Sampel	41
4.2	Analisis Data	42
4.2.1	Analisis Statistik Deskriptif	42
4.2.2	Pengujian Asumsi Klasik	44
4.2.3	Uji Analisis Regresi Linier Berganda	48
4.2.4	Uji Kebaikan Model (<i>Goodnes Of Fit</i>)	50
4.3	Pembahasan	54
4.3.1	Pengaruh ROA Terhadap <i>Return Saham</i>	54

4.3.2	Pengaruh Nilai Perusahaan Terhadap <i>Return</i> Saham	55
4.3.3	Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return</i> Saham	56
BAB V	58
KESIMPULAN	58
5.1	Kesimpulan	58
5.2	Keterbatasan Penelitian	59
5.3	Saran.....	60
Daftar Pustaka	62
LAMPIRAN	66

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 <i>Research Gap</i>	5
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	18
Tabel 3.1 Tabel Definisi Operasional Variabel	30
Tabel 4.1 Sampel Penelitian.....	41
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	43
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Data.....	45
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas.....	46
Tabel 4.5 Hasil Uji Heteroskedasitas	46
Tabel 4.7 Hasil Uji Autokorelasi.....	48
Tabel 4.8 Regresi Linier Berganda.....	49
Tabel 4.9 Hasil Uji t.....	50
Tabel 4.10 Hasil Uji F.....	53
Tabel 4.11 Hasil Uji Determinasi.....	53

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	24

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 : DAFTAR SAMPEL PERUSAHAAN

LAMPIRAN 2 : TABULASI DATA PERUSAHAAN LQ 45

LAMPIRAN 3 : DATA HASIL PENGOLAHAN