

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN DOSEN PENGUJI	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
ABSTRAK	xvi
ABSTRACT	xvii
INTISARI	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori dan Pengembangan Hipotesis	10
2.1.1 Landasan Teori	10

2.1.1.1	<i>Entity Theory</i> (Teori Entitas)	10
2.1.2	Variabel-Variabel Penelitian	11
2.1.2.1	Return Saham	11
2.1.2.2	Arus Kas dari Aktivitas Operasi	12
2.1.2.3	Arus Kas dari Aktivitas Investasi	12
2.1.2.4	Arus Kas dari Aktivitas Pendanaan	13
2.1.2.5	Laba Akuntansi	13
2.1.2.6	Risiko Sistematis	14
2.1.2.7	Risiko Non Sistematis	14
2.1.3	Penelitian Terdahulu	15
2.1.4	Kerangka Pemikiran Teoritis dan Pengembangan Hipotesis	17
2.1.4.1	Pengaruh Arus Kas dari Aktivitas Operasi terhadap <i>Return Saham</i>	17
2.1.4.2	Pengaruh Arus Kas dari Aktivitas Investasi terhadap <i>Return Saham</i>	18
2.1.4.3	Pengaruh Arus Kas dari Aktivitas Pendanaan terhadap <i>Return Saham</i>	19
2.1.4.4	Pengaruh Laba Akuntansi terhadap <i>Return Saham</i>	20
2.1.4.5	Pengaruh Risiko Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	21
2.1.4.6	Pengaruh Risiko Non Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	21
2.1.5	Kerangka Penelitian	22
BAB III METODE PENELITIAN		23
3.1	Jenis Penelitian	23
3.2	Populasi dan Sampel	23
3.3	Variabel, Definisi Operasional Variabel dan Pengukuran Variabel	24
3.3.1	Variabel Penelitian	24

3.3.2 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	25
3.4 Jenis dan Sumber Data.....	27
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	27
3.6 Teknik Analisis Data.....	28
3.6.1 Uji Asumsi Klasik.....	29
3.6.1.1 Uji Normalitas.....	29
3.6.1.2 Uji Multikolinieritas.....	30
3.6.1.3 Uji Autokorelasi.....	30
3.6.1.4 Uji Heteroskedastitas.....	31
3.6.2 Uji Regresi Linear Berganda.....	31
3.6.2.1 Statistik Deskriptif.....	31
3.6.2.2 Uji Hipotesis.....	31
3.6.2.2.1 Uji Signifikansi (Uji F).....	31
3.6.2.2.2 Uji Koefisien Determinasi (Adjusted R ²).....	32
3.6.2.2.3 Uji t-test (Uji t).....	32
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	34
4.1 Hasil Penelitian.....	34
4.1.1 Deskripsi Sampel.....	34
4.1.2 Deskripsi Variabel.....	36
4.1.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	36
4.2 Analisis Data.....	40
4.2.1. Uji Asumsi Klasik.....	40
4.2.1.1 Uji Normalitas.....	40

4.2.1.2 Uji Multikolinieritas	42
4.2.1.3 Uji Autokorelasi	43
4.2.1.4 Uji Heteroskedastitas	44
4.3 Regresi Berganda	47
4.3.1 Pengujian Signifikan Parameter Simultan (Uji F)	47
4.3.2 Koefisien Determinasi (R^2)	48
4.3.3 Model Persamaan Regresi Berganda	49
4.3.4 Pengujian Hipotesis	51
4.3.4.1 Pengujian Hipotesis (H1)	51
4.3.4.2 Pengujian Hipotesis (H2)	51
4.3.4.3 Pengujian Hipotesis (H3)	51
4.3.4.4 Pengujian Hipotesis (H4)	52
4.3.4.5 Pengujian Hipotesis (H5)	52
4.3.4.6 Pengujian Hipotesis (H6)	52
4.4 Pembahasan	52
4.4.1 Pengaruh Arus Kas Operasi terhadap <i>Return Saham</i>	53
4.4.2 Pengaruh Arus Kas Investasi terhadap <i>Return Saham</i>	54
4.4.3 Pengaruh Arus Kas Pendanaan terhadap <i>Return Saham</i>	55
4.4.4 Pengaruh Laba Akuntansi terhadap <i>Return Saham</i>	57
4.4.5 Pengaruh Risiko Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	55
4.4.6 Pengaruh Risiko Non Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	57
BAB V PENUTUP	58
5.1 Kesimpulan	58

5.2 Saran	59
5.3 Keterbatasan Penelitian.....	60
DAFTAR PUSTAKA	61
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu	15
Tabel 3.1	Definisi Operasional Variabel	25
Tabel 4.1	Casewise Diagnostics ^a	34
Tabel 4.2	Casewise Diagnostics ^a	34
Tabel 4.3	Casewise Diagnostics ^a	34
Tabel 4.4	Distribusi Sampel	35
Tabel 4.5	Statistik Deskriptif	36
Tabel 4.6	Uji Normalitas Data	40
Tabel 4.8	Uji Autokorelasi	43
Tabel 4.9	Hasil Perhitungan Uji Glejser	44
Tabel 4.10	Model Persamaan Regresi	45
Tabel 4.11	Hasil Uji Signifikansi Simultan	47
Tabel 4.12	Koefisien Determinasi (R^2)	48

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	22
--------------------------------------	----

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Daftar Nama Perusahaan	63
Lampiran 2	Tabulasi Data.....	64
Lampiran 3	Hasil Uji Statistik.....	67