

DAFTAR ISI

SAMPUL DALAM	ii
PERSETUJUAN PEMBIMBING	iii
PENGESAHAN	iv
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN	v
SURAT PERNYATAAN KESEDIAAN PUBLIKASI	vi
MOTTO	vii
PERSEMBAHAN.....	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
ABSTRAK	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah.....	12
C. Rumusan Masalah	13
D. Tujuan Penelitian	14
E. Manfaat Penelitian	15
F. Ruang Lingkup dan Batasan Masalah	17
G. Penegasan Istilah	19
H. Sistematika Pembahasan.....	22
BAB II LANDASAN TEORI.....	24
A. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	24
B. <i>Return Saham</i>	25

C. Profitabilitas	27
D. Likuiditas	32
E. Solvabilitas	35
F. Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) Terhadap <i>Return Saham</i>	38
G. Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) Terhadap <i>Return Saham</i>	40
H. Pengaruh Rasio Lancar (<i>Current Ratio</i>) Terhadap <i>Return Saham</i>	41
I. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) Terhadap <i>Return Saham</i>	43
J. Penelitian Terdahulu	45
K. Kerangka Konseptual.....	55
L. Hipotesis Penelitian	59
BAB III METODE PENELITIAN	61
A. Pendekatan Penelitian dan Jenis Penelitian	61
1. Pendekatan Penelitian	61
2. Jenis Penelitian	62
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian	62
C. Sumber Data, Variabel dan Skala Pengukuran	66
D. Teknik Pengumpulan Data	68
E. Teknik Analisis Data.....	68
1. Statistik Deskriptif	70
2. Model Estimasi Regresi Data Panel	70
3. Uji Kesesuaian Model Regresi Data Panel	72
4. Uji Asumsi Klasik	75
5. Uji Hipotesis	77
BAB IV HASIL PENELITIAN	80
A. Gambaran Umum Objek Penelitian	80
1. PT. AKR Corporindo Tbk.	81
2. PT. Indosat Tbk.	82
3. PT. Adhi Karya (Persero) Tbk.	82

4. PT. Jaya Kontruksi Manggala Pratama Tbk.	83
5. PP (Persero) Tbk.	84
6. Cardig Aero Services Tbk.	85
7. PT. Bali Towerindo Sentra Tbk.	86
8. PT. Blue Bird Tbk.	86
9. PT. Wijaya Karya Bangunan Gedung Tbk.	87
10. PT. Indonesia Kendaraan Terminal Tbk.	87
B. Analisis Deskriptif Data	88
C. Teknik Analisis Data.....	99
BAB V PEMBAHASAN	111
A. Pengaruh <i>Return on Asset</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	111
B. Pengaruh <i>Return on Equity</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	115
C. Pengaruh <i>Current Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	118
D. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	122
E. Pengaruh ROA, ROE, CR dan DER Terhadap <i>Return Saham</i>	126
BAB VI PENUTUP	129
A. Kesimpulan	129
B. Saran	131
DAFTAR PUSTAKA	133

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Kerangka Konseptual Penelitian	55
Tabel 3.1 Distribusi Sampel Penelitian.....	65
Tabel 3.2 Nama Perusahaan.....	65
Tabel 3.3 Skala Pengukuran	67
Tabel 4.1 Hasil Statistik Deskriptif	88
Tabel 4.2 Hasil Uji Chow	100
Tabel 4.3 Hasil Uji Hausman.....	101
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas.....	102
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinieritas	102
Tabel 4.6 Hasil Uji Heteroskedasitas	103
Tabel 4.7 Hasil Uji t	106
Tabel 4.8 Hasil Uji F	109
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefesien Determinasi (Adjusted R ²).....	109

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Tingkat Literasi dan Inklusi Pasar Modal di Indonesia	2
Gambar 4.1 <i>Return Saham</i>	90
Gambar 4.2 <i>Return on Assets</i>	92
Gambar 4.3 <i>Return on Equity</i>	94
Gambar 4.4 <i>Current Ratio</i>	96
Gambar 4.5 <i>Debt to Equity Ratio</i>	98

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Variabel Penelitian (Data Diolah)	146
Lampiran 2: Uji Statistik Deskriptif.....	148
Lampiran 3: Hasil Data Menggunakan <i>Common Effect Model</i>	149
Lampiran 4: Hasil Data Menggunakan <i>Fixed Effect Model</i>	149
Lampiran 5: Hasil Data Menggunakan <i>Random Effect Model</i>	150
Lampiran 6: Hasil Uji Chow.....	150
Lampiran 7: Hasil Uji Hausman.....	151
Lampiran 8: Hasil Data Uji T, Uji F, Uji R	151
Lampiran 9: Hasil Uji Data Normalitas	152
Lampiran 10: Hasil Uji Data Multikolinieritas.....	152
Lampiran 11: Hasil Uji Heterokedastisitas.....	153
Lampiran 14: Kendali Bimbingan Skripsi	154
Lampiran 12: Daftar Riwayat Hidup.....	168