

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
ABSTRAK	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
BAB I	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Pertanyaan Penelitian	5
1.4. Tujuan Penelitian	5
1.5. Manfaat Penelitian	6
1.6. Lingkup Penelitian	7
1.7. Sistematika Penulisan	7
BAB II.....	9
2.1. Landasan Teori	9
2.1.1. <i>Signaling theory</i>	9
2.1.2. <i>Trade-off theory</i>	10
2.1.3. <i>Agency theory</i>	10
2.1.4. <i>Capital gains yield</i>	11
2.1.5. Rasio-rasio keuangan (<i>financial ratios</i>).....	11
2.1.5.1. Rasio likuiditas (<i>liquidity ratio</i>).....	12
2.1.5.2. Rasio <i>leverage</i>	12
2.1.5.3. Rasio profitabilitas (<i>profitability ratio</i>).....	13
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	13
2.3. Perumusan Hipotesis.....	17
2.3.1. Pengaruh likuiditas terhadap <i>return</i> saham.....	17
2.3.2. Pengaruh <i>leverage</i> terhadap <i>return</i> saham.....	18
2.3.3. Pengaruh profitabilitas terhadap <i>return</i> saham	19

2.4. Model Penelitian	20
BAB III.....	21
3.1. Desain Penelitian.....	21
3.2. Metoda Pengumpulan Data.....	22
3.2.1. Desain pengumpulan data.....	22
3.2.2. Desain instrumen pengukuran	22
3.3. Instrumen Penelitian	23
3.4. Metoda Analisis Data	25
BAB IV	27
4.1. Deskripsi Data.....	27
4.2. Uji Akurasi Instrumen.....	28
4.2.1. Analisis statistik deskriptif.....	28
4.2.2. Uji normalitas	30
4.2.3. Uji multikolinearitas	31
4.2.4. Uji heteroskedastisitas	32
4.2.5. Uji autokorelasi.....	33
4.3. Pengujian Hipotesis.....	34
4.3.1. Uji koefisien determinasi (R^2)	34
4.3.2. Uji pengaruh simultan (F test).....	35
4.3.3. Uji parsial (t test)	36
4.4. Diskusi dan Pembahasan.....	38
4.4.1. Pengujian atas hipotesis H_1 bahwa rasio likuiditas CR (<i>current ratio</i>) berpengaruh positif dan signifikan terhadap <i>return</i> saham.	38
4.4.2. Pengujian atas hipotesis H_2 bahwa rasio <i>leverage</i> DER (<i>debt to equity ratio</i>) berpengaruh negatif dan signifikan terhadap <i>return</i> saham.	39
4.4.3. Pengujian atas hipotesis H_3 bahwa rasio profitabilitas ROA (<i>return on asset</i>) berpengaruh positif dan signifikan terhadap <i>return</i> saham.	40
BAB V.....	43
5.1. Simpulan	43
5.2. Implikasi.....	44
5.3. Keterbatasan.....	45
5.4. Saran.....	46
DAFTAR PUSTAKA	47
LAMPIRAN	49