

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	7
1.6 Sistematika Laporan Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	9
2.1 Tinjauan Pustaka	9
2.1.1 <i>Stock return</i>	9
2.1.2 <i>Current Ratio</i>	9
2.1.3 <i>Total Assets Turnover Ratio</i>	10
2.1.4 <i>Debt-to-Equity Ratio</i>	10
2.1.5 <i>Return on Equity</i>	11
2.1.6 <i>Price/Earning Ratio</i>	11
2.1.7 <i>Gross Domestic Product</i>	11
2.1.8 <i>Inflation</i>	12
2.1.9 <i>Signalling Theory</i>	12
2.2 Penelitian Sebelumnya.....	13

2.3 Pengembangan Hipotesis	15
2.3.1 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	15
2.3.2 Pengaruh <i>Total Assets Turnover Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	15
2.3.3 Pengaruh <i>Debt-to-Equity Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	16
2.3.4 Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap <i>Stock Return</i>	17
2.3.5 Pengaruh <i>Price/Earning Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	18
2.3.6 Pengaruh <i>Gross Domestic Product</i> terhadap <i>Stock Return</i>	18
2.3.7 Pengaruh <i>Inflation</i> terhadap <i>Stock Return</i>	19
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1 Jenis Penelitian	21
3.2 Data dan Sampel.....	21
3.2.1 Data	21
3.2.2 Sampel	21
3.3 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	22
3.3.1 Variabel Dependen.....	22
3.3.2 Variabel Independen	22
3.4 Model Empiris.....	25
3.5 Metode Analisis Data	26
3.5.1 Statistik Deskriptif	26
3.5.2 Analisis Regresi Data Panel	26
3.5.3 Pemilihan Model Regresi Data Panel	27
3.5.4 Uji Asumsi Klasik	29
3.5.5 Pengujian Hipotesis.....	31
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	32
4.1 Statistik Deskriptif.....	32
4.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel dan Metode Estimasi	35
4.2.2 <i>Fixed Effect Model</i>	36
4.2.3 <i>Random Effect Model</i>	37
4.2.4 Uji Chow	38
4.2.5 Uji Hausman	39
4.2.6 Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	40
4.3 Uji Asumsi Klasik	40
4.3.1 Uji Normalitas.....	41
4.3.2 Uji Multikolinieritas.....	42

4.3.3 Uji Heteroskedastisitas	43
4.3.4 Uji Autokorelasi.....	45
4.4 Pengujian Hipotesis	45
4.4.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	45
4.4.2 Uji Statistik F (Simultan).....	47
4.4.3 Uji Statistik t (Parsial)	47
4.5 Pembahasan.....	54
4.5.1 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	54
4.5.2 Pengaruh <i>Total Asset Turnover Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	54
4.5.3 Pengaruh <i>Debt-to-Equity Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	55
4.5.4 Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap <i>Stock Return</i>	56
4.5.5 Pengaruh <i>Price/Earning Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	57
4.5.6 Pengaruh <i>Gross Domestic Product</i> terhadap <i>Stock Return</i>	57
4.5.7 Pengaruh <i>Inflation</i> terhadap <i>Stock Return</i>	59
BAB V KESIMPULAN	61
5.1 Kesimpulan	61
5.2 Implikasi	61
5.3 Keterbatasan.....	62
5.4 Saran	62
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN	66