

DAFTAR ISI

| | |
|---|-----|
| HALAMAN JUDUL | i |
| LEMBAR PENGESAHAN | ii |
| PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS | iii |
| KATA PENGANTAR | iv |
| DAFTAR ISI | vi |
| DAFTAR TABEL..... | ix |
| DAFTAR GAMBAR..... | ix |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | x |
| INTISARI | xi |
| ABSTRACT | xii |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 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 | 6 |
| 1.7. Sistematika Penulisan..... | 7 |

| | |
|---|----|
| BAB II LANDASAN TEORI..... | 8 |
| 2.1. Landasan Teori..... | 8 |
| 2.1.1. Analisis Laporan Keuangan..... | 8 |
| 2.1.2. Hubungan antara Informasi Keuangan dengan <i>Return Saham</i> | 9 |
| 2.1.3. <i>Earning</i> | 10 |
| 2.1.4. <i>Cash Flow</i> | 11 |
| 2.1.5. Regresi Logistik..... | 12 |
| 2.2. Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis..... | 13 |
| 2.3. Model Penelitian..... | 18 |
| BAB III METODA PENELITIAN..... | 19 |
| 3.1. Desain Penelitian..... | 19 |
| 3.2. Metoda Pengumpulan Data..... | 22 |
| 3.3. Instrumen Penelitian..... | 23 |
| 3.4. Metoda Analisis Data..... | 32 |
| 3.4.1. Analisis Regresi Logistik Multivariat..... | 33 |
| 3.4.2. Memprediksi <i>Return Saham</i> | 33 |
| 3.4.3. Uji <i>Robustness</i> | 35 |

| | |
|--|----|
| BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN | 37 |
| 4.1. Deskripsi Data | 37 |
| 4.2. Uji Akurasi Instrumen | 42 |
| 4.2.1. Uji Regresi Pertama | 42 |
| 4.2.2. Uji Regresi Kedua | 45 |
| 4.2.3. Prediksi <i>Return</i> Saham | 47 |
| 4.2.4. Uji return Saham Lebih Lanjut | 51 |
| 4.2.5. Risk-Adjusted Returns | 53 |
| 4.3. Pengujian Hipotesis | 54 |
| 4.4. Diskusi dan Pembahasan | 57 |
| BAB V SIMPULAN | 60 |
| 5.1. Simpulan | 60 |
| 5.2. Implikasi | 61 |
| 5.3. Keterbatasan | 61 |
| 5.4. Saran | 63 |
| DAFTAR PUSTAKA | 64 |
| LAMPIRAN | i |