

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
ABSTRACT	ii
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	ii
DAFTAR TABEL	ii
DAFTAR GAMBAR.....	ii
DAFTAR LAMPIRAN.....	
BAB I PENDAHULUAN.....	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	13
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	13
1. <i>Tujuan penelitian</i>	13
2. <i>Kontribusi penelitian</i>	14
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka.....	15
1. <i>Laporan keuangan</i>	15
a. <i>Pengertian laporan keuangan</i>	15
b. <i>Tujuan laporan keuangan</i>	15
2. <i>Rasio keuangan</i>	16
3. <i>Return saham</i>	20

4. <i>Investasi</i>	22
5. <i>Pasar modal</i>	22
6. <i>Penelitian terdahulu</i>	22
B. Rerangka Pemikiran	26
1. <i>Hubungan Dividend Payout Ratio (DPR) terhadap Return saham</i>	27
2. <i>Hubungan Price Earning Ratio (PER) terhadap Return Saham</i>	27
3. <i>Hubungan Price Book Value (PBV) terhadap Return Saham</i>	28
C. Hipotesis.....	29
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Waktu dan Tempat Penelitian	30
B. Desain Penelitian.....	30
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	30
1. Definisi operasional variabel-variabel penelitian	31
a. Variabel dependen.....	31
b. Variabel independen	31
D. Pengukuran variabel.....	32
E. Populasi dan Sampel Penelitian.....	33
1. Populasi penelitian	33
2. Sampel penelitian.....	33
F. Teknik Pengumpulan Data	37
G. Metode analisis	38
1. Statistik deskriptif	38
2. Analisis kelayakan data.....	38

3. Uji asumsi klasik.....	39
a. Uji normalitas	39
b. Uji autokolerasi	40
c. Uji multikolonieritas	41
d. Uji heteroskedastisitas	42
4. Uji kesesuaian model	42
a. Common effect model	43
b. Fixed effect model	43
c. Random effect	44
5. Pengujian model regresi data panel	5
a. Uji chow test.....	45
b. Uji hausman	46
6. Koefisien determinasi (R^2).....	46
7. Pengujian hipotesis	47
a. Uji hipotesis secara parsial (Uji T).....	47
8. Uji analisis regresi linier berganda.....	49
BAB IV PEMBAHASAN	
A. Gambaran umum.....	50
B. Statistik deskriptif	55
C. Analisis kelayakan data	57
1. Uji stasioner <i>return</i> saham	58
2. Uji stasioner <i>dividend payout ratio</i>	58
3. Uji stasioner <i>price earning ratio</i>	59

4. Uji stasioner <i>price book value</i>	60
D Uji asumsi klasik.....	60
1. Uji normalitas.....	60
2. Uji multikolinearitas	61
3. Uji autokolinearitas	62
4. Uji heteroskedastisitas.....	63
E. Model regresi data panel.....	63
1. <i>Common effect model</i>	63
2. <i>Fixed effect model</i>	65
F. Pemilihan model regresi data panel	66
1. Uji <i>chow test</i>	66
G. Uji koefisien determinasi (R^2).....	68
H. Pengujian hipotesis	68
1. Uji T	68
a. <i>Dividend payout ratio</i> (DPR).....	68
b. <i>Price earning ratio</i> (PER).....	69
c. <i>Price book value</i> (PBV)	69
2. Analisis model regresi data panel	69
I. Pembahasan	71
1. Pengaruh <i>Dividend payout ratio</i> (DPR) terhadap <i>return</i> saham.....	71
2. Pengaruh <i>Price earning ratio</i> (PER) terhadap <i>return</i> saham.....	71
3. Pengaruh <i>Price book value</i> (PBV) terhadap <i>return</i> saham.....	71

BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
A. Simpulan	72
B. Saran	72
DAFTAR PUSTAKA	74
LAMPIRAN	75



UNIVERSITAS
MERCU BUANA