

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRACT.....	iii
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	9
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	10
1. Tujuan penelitian.....	10
2. Kontribusi Penelitian.....	10
BAB II.....	11
KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS.....	11
A. Kajian Pustaka.....	11
1. Manajemen Keuangan.....	11
2. Investasi Pasar Modal.....	11
3. Teori Sinyal	12
4. Return Saham.....	14
5. Kinerja Keuangan.....	15
6. Ringkasan Kajian Riset Terdahulu.....	18
B. Rerangka Pemikiran.....	21
C. Pengembangan Hipotesis.....	22
1. Pengaruh <i>Earnings Per Share</i> (EPS) terhadap Return Saham	22
2. Pengaruh <i>Price Earnings Ratio</i> (PER) terhadap Return Saham.	22
3. Pengaruh <i>Debt To Equity Ratio</i> (DER) terhadap Return Saham.	23

BAB III.....	24
METODE PENELITIAN.....	24
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	24
B. Desain dan Jenis Penelitian.....	24
C. Definisi Variabel dan Operasionalisasi Variable	25
1. Definisi Variabel Penelitian.....	25
2. Definisi Operasionalisasi Variabel.....	25
D. Populasi dan Sampel.....	26
1. Populasi	26
2. Sampel	26
E. Jenis Data dan Metode Pengumpulan Data.....	28
F. Metode Analisis Data	29
1. Analisis Deskriptif	29
2. Analisis Kualitas Data.....	30
3. Uji Asumsi Klasik.....	31
4. Analisis Regresi Data Panel.....	34
5. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	36
6. Uji Kesesuaian Model Regresi Data Panel.....	40
7. Uji Hipotesis.....	41
BAB IV	42
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	42
A. Gambaran Obyek Penelitian	42
1. PT. Astra Agro Lestari Tbk.(AALI)	42
2. PT. Sampoerna Agro Tbk. (SGRO).....	43
3. PT. Sinar Mas Agro Resources and Technology Tbk. (SMAR).....	43
4. PT. Tunas Baru Lampung Tbk. (TBLA)	44
5. PT. Dharma Samudera Fishing Indonesia Tbk. (DSFI)	44
6. PT. Bisi International Tbk. (BISI).....	45
7. PT. Central Proteina Prima Tbk. (CPRO).....	45
B. Analisis Statistik Deskriptif	46
C. Analisis Kualitas Data.....	48

Uji Stasioneritas.....	48
D. Uji Asumsi Klasik.....	52
1. Uji Normalitas.....	52
2. Uji Autokorelasi.....	53
3. Uji Multikolinearitas.....	54
4. Uji Heterokedastisitas.....	55
E. Analisis Regresi Data Panel.....	56
1. Common Effect.....	57
2. Fixed Effect.....	58
3. Random Effects.....	60
F. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	62
Uji Chow-Test.....	62
G. Analisis Model Regresi Data Panel.....	63
H. Uji Kesesuaian Model Regresi Data Panel.....	65
1. Analisis Koefisien Determinasi ().....	65
2. Uji Statistik F.....	66
I. Hasil Uji Hipotesis.....	67
J. Pembahasan Hasil Penelitian.....	68
1. Pengaruh <i>Earnings Per Share</i> (EPS) terhadap Return saham.....	68
2. Pengaruh <i>Price to Earnings Ratio</i> (PER) terhadap Return saham.....	70
3. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap Return saham.....	71
BAB V.....	73
KESIMPULAN DAN SARAN.....	73
A. Kesimpulan.....	73
B. Saran-saran.....	73
DAFTAR PUSTKA.....	77
LAMPIRAN.....	80