

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iii
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	9
1. Tujuan Penelitian.....	9
2. Kontribusi Penelitian.....	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	
A. Kajian Teoritis.....	11
1. Return Saham	11
a. Pengertian Return Saham.....	11
b. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Return Saham	13
2. Teori Sinyal (Signalling Theory)	16
3. Analisis Rasio Keuangan.....	17
a. Pengertian Analisis Rasio Keuangan	17
b. Bentuk-bentuk Rasio Keuangan	17
4. Variabel Indikator Ekonomi Makro	19
5. Penelitian Terdahulu.....	20
B. Rerangka Konseptual.....	27

C. Pengembangan Hipotesis.....	27
--------------------------------	----

BAB III METODE PENELITIAN

A. Waktu dan Tempat Penelitian	32
1. Waktu Penelitian	32
2. Tempat Penelitian	32
B. Desain Penelitian.....	32
C. Definisi dan Operasional Variabel	33
D. Populasi dan Sampel Penelitian	35
1. Populasi Penelitian	35
2. Sampel Penelitian.....	35
E. Teknik Pengumpulan Data	37
F. Metode Analisis Data.....	38
1. Analisis Deskriptif.....	38
2. Uji Stasioneritas Data.....	38
3. Analisis Regresi Data Panel	39
a) Common Effect Model (Pooled Least Square).....	40
b) Fixed Effect Model	41
c) Random Effect Model	41
4. Uji Pemilihan Model	42
a) Uji Chow.....	42
b) Uji Hausman	43
5. Pengujian Hipotesis	44
a) Uji Koefisien Determinasi (Uji R^2)	44
b) Uji Simultan (Uji Statistik F)	44
c) Uji Hipotesis (Uji t)	45

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum	46
B. Statistik Deskriptif	50
C. Hasil Uji Stasioneritas Data	53

D. Hasil Analisis Regresi Data Panel.....	53
1. Model Common Effect.....	54
2. Model Fixed Effect.....	56
3. Model Random Effect	58
E. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	61
1. Uji Chow	61
2. Uji Hausman.....	62
F. Hasil Uji Hipotesis.....	62
1. Uji Koefisien Determinasi	63
2. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	63
3. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	64
G. Pembahasan	67
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
A. Simpulan	71
B. Saran.....	71
DAFTAR PUSTAKA.....	74
LAMPIRAN.....	77

UNIVERSITAS
MERCU BUANA