

## DAFTAR ISI

<b>SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....</b>	<b>i</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI .....</b>	<b>ii</b>
<b>ABSTRACT.....</b>	<b>iii</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN.....</b>	<b>xiii</b>
<b>BAB 1 PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah .....	6
C. Tujuan .....	7
D. Manfaat Penelitian .....	7
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS</b>	
A. Kajian Pustaka.....	8
1. Teori Sinyal (Signalling Theory) .....	9
2. Teori Agensi (Agency Theory) .....	9
3. Return Saham .....	10
4. Return On Asset .....	12
5. Ukuran Perusahaan.....	13
6. Volume Perdagangan .....	14
7. Kajian Penelitian Terdahulu.....	17
B. Rerangka Pemikiran dan Hipotesis .....	25

1. Rerangka Pemikiran .....	25
2. Hipotesis .....	29

### **BAB III METODE PENELITIAN**

A. Waktu dan Tempat Penelitian .....	30
B. Desain Penelitian.....	31
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	31
1. Variabel Terikat (Dependent Variable).....	31
2. Variabel Bebas (Independent Variable).....	32
D. Populasi dan Sampel Penelitian .....	34
E. Metode Pengumpulan Data.....	37
F. Metode Analisis .....	37
1. Statistik Deskriptif.....	37
2. Uji Asumsi Klasik .....	38
a) Uji normalitas.....	38
b) Uji Multikolonieritas.....	39
c) Uji Autokorelasi.....	40
d) Uji Heteroskedastisitas (Heteroskedasticity Test).....	41
3. Uji Kelayakan Model .....	42
a) Uji Koefisien Determinasi .....	42
b) Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	43
4. Uji Hipotesis.....	44
a) Analisis Regresi Linear Berganda.....	44
b) Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t).....	45

### **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

A. Gambaran Umum .....	47
B. Statistik Deskriptif .....	47
C. Uji Asumsi Klasik.....	50
1. Uji Normalitas.....	50
2. Hasil Uji Multikolinearitas.....	52
3. Hasil Uji Autokorelasi.....	53
4. Hasil Uji Heteroskedastisitas .....	54
D. Hasil Uji Kelayakan Model.....	54
1. Hasil Uji Koefisien Determinasi (Uji $R^2$ ).....	54
2. Hasil Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	55
E. Hasil Uji Hipotesis .....	56

1. Hasil Analisis Regresi Berganda.....	56
2. Hasil Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t) .....	58
F. Pembahasan.....	60
1. Pengaruh Return On Asset (ROA) terhadap return saham .....	60
2. Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap return saham .....	61
3. Pengaruh Volume Perdagangan Saham terhadap return saham...	62
 <b>BAB V SIMPULAN DAN SARAN</b>	
A. SIMPULAN .....	64
B. SARAN .....	65
1. Emiten .....	65
2. Bagi Investor dan calon investor.....	66
3. Bagi peneliti selanjutnya .....	66
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>68</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>71</b>

