

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	10
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	11
1. Tujuan penelitian.....	11
2. Kontribusi penelitian	12
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS ..	13
A. Kajian Pustaka.....	13
1. <i>Signaling theory</i>	13
2. <i>Stakeholder theory</i>	15
3. <i>Return saham</i>	16
4. <i>Abnormal return</i>	17
5. <i>Cumulative abnormal return</i>	20
6. <i>Return On Assets (ROA)</i>	21
7. <i>Return On Equity (ROE)</i>	23
8. <i>Earning Per Share (EPS)</i>	24
9. Ukuran perusahaan (<i>firm size</i>).....	25
10. Penelitian Terdahulu	27
B. Rerangka Pemikiran.....	41
1. Pengaruh ROA terhadap <i>abnormal return</i>	41
2. Pengaruh ROE terhadap <i>abnormal return</i>	42
3. Pengaruh EPS terhadap <i>abnormal return</i>	43
4. Pengaruh ukuran perusahaan terhadap <i>abnormal return</i>	43

C.	Hipotesis.....	45
BAB III METODE PENELITIAN		46
A.	Waktu dan Tempat Penelitian	46
B.	Desain Penelitian	46
C.	Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	46
1.	Definisi Variabel Penelitian.....	46
2.	Operasionalisasi Variabel	49
D.	Populasi dan Sampel Penelitian	50
1.	Populasi Penelitian	50
2.	Sampel Penelitian.....	50
E.	Teknik Pengumpulan Data.....	52
F.	Metode Analisis	53
1.	Uji Statistik Deskriptif.....	53
2.	Uji Asumsi Klasik.....	54
3.	Uji Kesesuaian Model	57
4.	Uji Hipotesis	59
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		62
A.	Gambaran Umum	62
B.	Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	63
1.	Rasio <i>Return On Assets</i> (ROA)	64
2.	Rasio <i>Return On Equity</i> (ROE).....	64
3.	Rasio <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	65
4.	Ukuran Perusahaan (SIZE).....	66
5.	<i>Cumulative Abnormal Return</i> (CAR).....	67
C.	Hasil Uji Asumsi Klasik	68
1.	Uji Normalitas Data	68
2.	Uji Multikolonieritas	69
3.	Uji Autokorelasi.....	70
4.	Uji Heteroskedastisitas	72
D.	Hasil Uji Kesesuaian Model.....	75
1.	Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	75
2.	Uji Fit Model (Uji F).....	76
E.	Hasil Uji Hipotesis.....	77
1.	Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji-t).....	77

2. Uji Analisis Regresi Linear Berganda.....	79
F. Pembahasan	81
1. Pengaruh <i>Return On Assets</i> (ROA) terhadap <i>Abnormal Return</i>	81
2. Pengaruh <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>abnormal return</i>	82
3. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap <i>abnormal return</i>	84
4. Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap <i>abnormal return</i>	85
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	88
A. Kesimpulan	88
B. Saran	89
DAFTAR PUSTAKA	90
LAMPIRAN	93



UNIVERSITAS
MERCU BUANA