

## DAFTAR ISI

<i>ABSTRACT</i> .....	i
ABSTRAK .....	ii
LEMBAR PERSETUJUAN .....	iii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iv
KATA PENGANTAR .....	v
DAFTAR ISI .....	vii
DAFTAR TABEL .....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR LAMPIRAN .....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian .....	1
1.2 Identifikasi, Pembatasan dan Perumusan Masalah Penelitian .....	5
1.2.1 Identifikasi Masalah .....	5
1.2.2 Pembatasan Masalah .....	9
1.2.3 Perumusan Masalah .....	9
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian .....	10
1.3.1 Tujuan Penelitian .....	10
1.3.2 Manfaat Penelitian .....	11
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS</b> .....	13
2.1. Kajian Pustaka .....	13
2.1.1 <i>Risk and Return</i> .....	13
2.1.2 <i>Signaling Theory</i> .....	14

2.1.3	<i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i> .....	15
2.1.4	<i>Asymmetric Information</i> .....	15
2.1.5	Return Saham .....	15
2.1.6	<i>Profitability Ratios</i> .....	16
2.1.7	<i>Leverage Ratios</i> .....	17
2.1.8	Rasio Nilai Pasar .....	18
2.1.9	Rasio Manajemen Aset .....	19
2.1.10	Rasio Operasional .....	20
2.2	Penelitian Terdahulu .....	21
2.3	Kerangka Pemikiran .....	26
2.4	Hipotesis .....	27
2.4.1	Pengaruh EPS Terhadap Return Saham .....	27
2.4.2	Pengaruh PER Terhadap Return Saham .....	28
2.4.3	Pengaruh ROE Terhadap Return Saham .....	28
2.4.4	Pengaruh DAR Terhadap Return Saham .....	29
2.4.5	Pengaruh NPM Terhadap Return Saham .....	29
2.4.6	Pengaruh PBV Terhadap Return Saham .....	29
2.4.7	Pengaruh RBK Terhadap Return Saham .....	30
2.4.8	Pengaruh RPP Terhadap Return Saham .....	30
2.4.9	Pengaruh TATO Terhadap Return Saham .....	31
2.4.10	Pengaruh DER Terhadap Return Saham .....	31
<b>BAB III</b>	<b>METODE PENELITIAN</b> .....	<b>32</b>
3.1.	Jenis Penelitian .....	32
3.2.	Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel .....	33
3.3.	Populasi dan Sampel .....	35
3.4.	Metode Pengumpulan Data .....	36

3.5. Metode Analisis Data .....	36
3.5.1. Analisis Statistik Deskriptif .....	37
3.5.2. Analisis Statistik Inferensial .....	37
<b>BAB IV PEMBAHASAN .....</b>	<b>48</b>
4.1. Deskripsi Industri .....	48
4.1.1. Sejarah Industri .....	48
4.1.2. Lingkup dan Bidang Usaha .....	49
4.1.3. Sumber Daya .....	49
4.1.4. Tantangan Bisnis .....	49
4.1.5. Proses/Kegiatan Fungsi Bisnis .....	50
4.2. Statistik Deskriptif .....	50
4.3. Statistik Inferensial .....	55
4.3.1. Uji Model Terbaik .....	55
4.3.2. Pengujian Model Regresi .....	56
4.3.3. Uji Model Panel Terbaik Data Transformasi .....	58
4.3.4. Pengujian Model Regresi Data Transformasi .....	59
4.4. Pembahasan .....	63
<b>BAB V KESIMPULAN &amp; SARAN .....</b>	<b>70</b>
5.1. Kesimpulan .....	70
5.2. Saran .....	71
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>73</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>	<b>78</b>
<b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP .....</b>	<b>90</b>