

## DAFTAR ISI

Halaman

PERNYATAAN

PENGESAHAN

KATA PENGANTAR.....i

ABSTRACT .....iv

ABSTRAK ..... v

DAFTAR ISI.....vi

DAFTAR TABEL ..... x

DAFTAR GAMBAR .....xi

DAFTAR LAMPIRAN..... xii

**BAB I        PENDAHULUAN**

A. Latar Belakang Penelitian ..... 1

B. Rumusan Masalah Penelitian..... 15

C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian ..... 15

1.1 Tujuan Penelitian..... 15

1.2 Kontribusi Penelitian ..... 16

1.2.1 Kontribusi Teori..... 16

1.2.2 Kontribusi Praktis..... 16

1.2.3 Kontribusi kebijakan ..... 16

**BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS**

A. Kajian Pustaka .....	17
2.1 <i>Return</i> Saham .....	19
2.1.1 Pengertian <i>Return</i> Saham .....	26
2.1.2 Komponen <i>Return</i> Saham .....	27
2.1.3 Metode Perhitungan <i>Return</i> Saham .....	28
2.1.4 Macam-macam <i>Return</i> Saham .....	29
2.1.5 Faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham .....	30
2.2 Rasio Keuangan.....	32
2.2.1 <i>Current Ratio</i> .....	40
2.2.2 <i>Return On Equity</i> .....	43
2.2.3 <i>Firm Size</i> .....	47
2.2.3.1 Pengertian <i>Firm Size</i> .....	47
2.2.3.2 Indikator pengukuran <i>firm size</i> .....	51
2.3 Penelitian Terdahulu .....	54
B. Rerangka Pemikiran.....	65
C. Hipotesis.....	69

**BAB III METODE PENELITIAN**

A. Jenis Penelitian .....	72
B. Definisi oprasionalisasi variabel.....	73
3.1 Definisi Variabel.....	73

3.1.1 Variabel Independen.....	73
3.1.2 Variabel Dependen .....	73
3.2 Operarionalisasi dan pengukuran Variabel .....	74
3.2.1 <i>Return Saham</i> .....	74
3.2.2 <i>Current Ratio</i> .....	74
3.2.3 <i>Return on equity</i> .....	75
3.2.4 <i>Firm size</i> .....	75
C. Populasi dan Sample Penelitian.....	77
D. Teknik Pengumpulan Data.....	79
E. Metode Analisis .....	80
3.3 Analisis Statistik Deskriptif.....	80
3.4 Uji Asumsi Klasik.....	81
3.4.1. Uji Normalitas .....	81
3.4.2 Uji Multikolonieritas .....	82
3.4.3 Uji Heteroskedastisitas .....	83
3.4.4 Uji Autokorelasi .....	84
3.5 Analisis Regresi Linier Berganda.....	85
3.6 Uji Hipotesis.....	86
3.6.1 Uji Secara Persial (Uji t).....	86
3.6.2 Uji Secara Simultan (Uji F) .....	87
3.7 Koefisien Determinasi (R <sup>2</sup> ).....	88

<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	
	A. Deskripsi Objek Penelitian .....	89
	B. Uji Asumsi klasik dan Analisi Regresi Berganda.....	91
	4.1 Uji Asumsi Klasik.....	91
	4.1.1 Uji Normalitas .....	92
	4.1.2 Uji Linieritas.....	94
	4.1.3 Uji Multikolonieritas.....	96
	4.1.4 Uji Heteroskedastisitas.....	97
	4.1.5 Uji Autokorelasi.....	98
	4.2 Analisis Regresi Berganda.....	99
	4.2.1 Persamaan Regresi .....	99
	4.2.2 Uji Hipotesis .....	100
	4.2.3 Koefisien Determinasi.....	103
	C. Pembahasan .....	104
<b>BAB V</b>	<b>SIMPULAN DAN SARAN</b>	
	A. Simpulan .....	109
	B. Saran .....	110
	<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>112</b>
	<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN.....</b>	<b>116</b>