

DAFTAR ISI

<i>ABSTRACT</i>	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
SURAT PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Identifikasi Masalah	12
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	13
BAB II. KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	15
2.1. Kajian Pustaka	15
2.1.1. Capital Asset Pricing Model	15
2.1.2. Signalling Theory	19
2.1.3. Return On Equity (ROE)	20
2.1.4. Earning Per Share (EPS)	22
2.1.5. Debt to Equity Ratio (DER)	23
2.1.6. Market Share	25
2.1.7. Return Saham	27

2.2. Penelitian Terdahulu	29
2.3. Kerangka Pemikiran	35
2.4. Hipotesis	35
2.4.1. Pengaruh ROE Terhadap Return Saham	35
2.4.2. Pengaruh EPS Terhadap Return Saham	37
2.4.3. Pengaruh DER Terhadap Return Saham	38
2.4.4. Pengaruh Market Share Terhadap Return Saham	39
BAB III. METODE PENELITIAN	41
3.1. Jenis Penelitian	41
3.2. Defenisi Operasional dan Pengukuran Variabel	41
3.2.1. Variabel Terikat	42
3.2.2. Variabel Bebas	43
3.2.3. Definisi Operasional	46
3.3. Populasi dan Sample	47
3.4. Metode Pengumpulan Data	49
3.5. Metode Analisis Data	50
3.5.1. Analisis Regresi Data Panel	50
3.5.2. Uji Pemilihan Model	52
3.5.3. Uji Asumsi Model Regresi Data Panel	55
3.5.4. Uji Hipotesis	56
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	62
4.1. Deskripsi Perusahaan	62
4.1.1. Perusahaan Konstruksi	62
4.1.2. Lingkup dan Bidang Usaha	64
4.1.3. Sumber Daya	65

4.1.4. Tantangan Bisnis	67
4.2. Hasil Penelitian	73
4.2.1. Regresi Data Panel Penelitian	73
4.2.2. Model Regresi Data Panel	79
4.2.3. Analisis Model Regresi Data Panel	85
4.2.4. Pengujian Hipotesis Penelitian	91
4.3. Pembahasan Hasil Penelitian	95
4.3.1. Pengaruh ROE Terhadap Return Saham	96
4.3.2. Pengaruh EPS Terhadap Return Saham	97
4.3.3. Pengaruh DER Terhadap Return Saham	99
4.3.4. Pengaruh Market Share Terhadap Return Saham	101
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	103
5.1. Kesimpulan	103
5.2. Keterbatasan Penelitian	104
5.3. Saran	104
DAFTAR PUSTAKA	106
LAMPIRAN	114
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	124