

DAFTAR ISI

	Halaman
<i>ABSTRACT</i>	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERSETUJUAN.....	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi dan Perumusan Masalah	7
1.2.1 Identifikasi Masalah	7
1.2.2 Perumusan Masalah	8
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	9
1.3.1 Tujuan Penelitian	9
1.3.2 Manfaat Penelitian	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS.....	11
2.1 Kajian Pustaka	11
2.1.1 Teori Sinyal	11
2.1.2 Investasi	11
2.1.2.1 Jenis – Jenis Investasi	12
2.1.2.2 Tujuan Investasi	13
2.1.3 Pasar Modal	14
2.1.3.1 Fungsi Pasar Modal.....	15
2.1.3.2 Instrumen Pasar Modal	16
2.1.3.3 Teori Efisiensi Pasar Modal	17
2.1.3.4 Tingkat atau Bentuk Efisiensi Pasar Modal	18

2.1.3.5 Manfaat Efisiensi Pasar Modal	20
2.1.4 Saham	21
2.1.4.1 Jenis – Jenis Saham	22
2.1.4.2 Harga Saham	23
2.1.5 Return Saham	24
2.1.5.1 Jenis – Jenis <i>Return</i> Saham	25
2.1.5.2 Komponen <i>Return</i> Saham	25
2.1.5.3 Faktor–faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	26
2.1.5.4 Faktor Internal yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	27
2.2 Penelitian Terdahulu	31
2.3 Kerangka Pemikiran	35
2.3 Hipotesis	36
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	40
3.1 Jenis Penelitian	40
3.2 Variabel Penelitian	40
3.2.1 Definisi Konsep	40
3.2.1.1 Variabel Terikat (<i>Dependent Variabel</i>)	41
3.2.1.2 Variabel Bebas (<i>Independent Variabel</i>)	41
3.2.2 Definisi Operasional Variabel	45
3.2.2.1 Variabel Terikat (<i>Dependent Variabel</i>)	42
3.2.2.2 Variabel Bebas (<i>Independent Variabel</i>)	43
3.3 Populasi dan Sampel	45
3.3.1 Populasi	45
3.3.2 Sampel	45
3.4. Metode Pengumpulan Data	47
3.5 Metode Analisis Data	48
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	48
3.5.2 Analisis Regresi Data Panel	48
3.5.2.1 Model Regresi Data Panel	50
3.5.2.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel	52
3.5.2.3 Pengujian Model	56
3.5.2.4 Pengujian Koefisien	58

BAB IV PEMBAHASAN HASIL PENELITIAN	60
4.1 Deskripsi Perusahaan	60
4.2 Statistik Deskriptif	61
4.3 Analisis Regresi Data Panel	66
4.3.1 Model Regresi Data Panel	66
4.3.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel	70
4.3.3 Pengujian Model	76
4.3.4 Pengujian Koefisien	78
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian	79
4.4.1 Pengaruh <i>Return On Asset</i> terhadap <i>Return Saham</i>	79
4.4.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i> ..	80
4.4.3 Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> terhadap <i>Return Saham</i>	81
4.4.4 Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> terhadap <i>Return Saham</i>	82
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	84
5.1 Kesimpulan	84
5.2 Keterbatasan Penelitian	84
5.3 Saran	85
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	