

DAFTAR ISI

| | Halaman |
|---|----------------|
| SAMPUL HALAMAN | i |
| LAMAN PENGAJUAN | ii |
| HALAMAN PENGESAHAN..... | iii |
| PERNYATAAN ORISINALITAS | iv |
| <i>ABSTRACT</i> | v |
| ABSTRAK | vi |
| KATA PENGANTAR | vii |
| DAFTAR ISI | x |
| DAFTAR TABEL..... | xiii |
| DAFTAR GAMBAR | xiv |
| DAFTAR LAMPIRAN | xv |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1 Latar Belakang Penelitian | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 4 |
| 1.3 Tujuan Penelitian | 4 |
| 1.4 Manfaat Penelitian | 4 |
| BAB II TINJAUAN KEPUSTAKAAN | 6 |
| 2.1 Landasan Teori dan Kajian Empiris..... | 6 |
| 2.1.1 Pasar Modal | 6 |
| 2.1.2 Efisiensi Pasar Modal | 8 |
| 2.1.3 Saham..... | 14 |
| 2.1.4 Return Saham | 16 |
| 2.1.4.1 Pengertian Return Saham | 16 |
| 2.1.4.2 Jenis-Jenis Return Saham | 17 |
| 2.1.4.3 Komponen-Komponen Return Saham | 17 |
| 2.1.4.4 Faktor yang Mempengaruhi Return Saham | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 2.1.5 Laporan Keuangan | 19 |
| 2.1.5.1 Pengertian Laporan Keuangan | 19 |
| 2.1.5.2 Tujuan Laporan Keuangan | 21 |
| 2.1.5.3 Karakteristik Laporan Keuangan | 22 |
| 2.1.5.4 Pengguna Laporan Keuangan | 22 |
| 2.1.6 Analisis Rasio Keuangan | 26 |
| 2.1.6.1 Rasio Likuiditas | 27 |
| 2.1.6.2 Rasio Solvabilitas | 28 |
| 2.1.6.3 Rasio Aktivitas | 30 |
| 2.1.6.4 Rasio Profitabilitas | 30 |
| 2.1.6.5 Rasio Pasar | 31 |
| 2.2 Penelitian Sebelumnya | 32 |
| 2.3 Kerangka Pemikiran | 35 |
| 2.4 Hipotesis Penelitian | 36 |
| | |
| BAB III METODE PENELITIAN | 37 |
| 3.1 Jenis Penelitian | 37 |
| 3.2 Populasi dan Sampel Penelitian | 37 |
| 3.3 Sumber Data..... | 38 |
| 3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional | 39 |
| 3.4.1 Variabel Penelitian | 39 |
| 3.4.2 Definisi Operasional : Variabel Dependen..... | 39 |
| 3.4.3 Definisi Operasional : Variabel Independen | 40 |
| 3.5 Metode Pengumpulan Data | 42 |
| 3.6. Tahapan Penelitian | 43 |
| 3.6.1 Pengujian Statistik Deskriptif | 43 |
| 3.6.2 Uji Asumsi Klasik | 43 |
| 3.6.2.1 Uji Normalitas | 43 |
| 3.6.2.2 Uji Heterokedastisitas | 44 |
| 3.6.2.3 Uji Autokorelasi | 45 |
| 3.6.2.4 Uji Multikolinearitas | 46 |

| | |
|--|-----------|
| 3.6.3 Analisis Regresi Linier Berganda | 47 |
| 3.6.4 Pengujian Hipotesis | 48 |
| 3.6.4.1 Uji T Statistik | 48 |
| 3.6.4.2 Uji F Statistik | 49 |
| | |
| BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... | 50 |
| 4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian..... | 50 |
| 4.2 Analisis Deskriptif Variabel Penelitian | 53 |
| 4.3 Analisis Data | 56 |
| 4.3.1 Uji Asumsi Klasik | 56 |
| 4.3.1.1 Uji Normalitas | 56 |
| 4.3.1.2 Uji Heterokedastisitas | 59 |
| 4.3.1.3 Uji Autokorelasi | 61 |
| 4.3.1.4 Uji Multikolinearitas | 62 |
| 4.4 Hasil Uji Hipotesis | 63 |
| 4.4.1 Analisis Regresi Linier Berganda | 64 |
| 4.4.2 Hasil Uji T (Uji Parsial) | 66 |
| 4.4.3 Hasil Uji F (Uji Simultan) | 69 |
| 4.5 Pembahasan | 70 |
| | |
| BAB V PENUTUP | 75 |
| 5.1 Kesimpulan | 75 |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian | 75 |
| 5.3 Saran | 76 |
| | |
| DAFTAR PUSTAKA | |
| LAMPIRAN | |