

DAFTAR ISI

	Halaman
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	11
1.3.1. Tujuan Penelitian.....	11
1.3.2. Kegunaan Penelitian.....	11
BAB II TELAAH PUSTAKA	
2.1 Telaah Pustaka dan Penelitian Terdahulu.....	13
2.1.1. Teori Sinyal.....	13
2.1.2. Retrun Saham	14
2.1.3. Kinerja Fundamental Perusahaan.....	16
2.1.4. <i>Economic Value Added</i> (EVA).....	18
2.1.5. <i>Return on Equity</i> (ROE).....	27
2.1.6. <i>Price Earning Ratio</i> (PER)	27
2.1.7. <i>Debt to Equty Ratio</i> (DER)	28
2.1.8. <i>Current Rasio</i> (CR)	29
2.2 Penenlitian Terdahulu.....	30
2.2.1 Hasil Penelitian Shahib Natarsyah (2000).....	30
2.2.2 Siddartha Utama dan Anto Yulianto Budi Santosa (1998)	30
2.2.3 James L. Dodd and Shimin Chen (1996).....	31
2.2.4 Lehn, Kenneth and Makhija, Anil K. (1996)	31
2.2.5 Jogyianto Hartono dan Chendrawati (1999)	32
2.2.6 Imam Ghozali dan Irwansyah (2002).....	32
2.2.7 Pancawati Hardiningsih, L. Suryanto, dan Anis Chariri (2002).....	33

2.2.8	Juliati Sjarief, dan Aruna Wirjolukito (2004)..	34
2.2.9	Surifah dan Nuri Hidayah (2004).....	34
2.2.10	Njo Anastasia, Yanny Widiastuty Gunawan, Imelda Wijiyanti (2003).....	36
2.2.11	Hasil penelitian Yogo Purnomo (1998)	36
2.2.12	Antariksa Budileksmana dan Barbara Gunawan (2003).....	37
2.3	Pengaruh Hubungan Variabel Bebas dengan Variabel Terikat Dan Rumusan Hipotesis	41
2.3.1	Pengaruh Economic Value Added (EVA) terhadap Return Saham.....	41
2.3.2	Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) terhadap Return Saham.....	42
2.3.3	Pengaruh Price Earning Ratio (PER) terhadap return Saham	44
2.3.4	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap Return Saham.....	46
2.3.5	Pengaruh Current Rasio (CR) terhadap Return saham	48
2.4.	Kerangka Pemikiran.....	49
2.5	Hipotes.....	52

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Definisi Operasional Variabel	53
3.2	Jenis dan Sumber Data.....	55
3.3	Populasi dan Penentuan Sampel	55
3.4	Metode pengumpulan data.....	57
3.5	Metode analisis data	57
3.5.1.	Statistik Deskriptif.....	57

3.5.2.	Uji Asumsi Klasik	58
3.5.3.	Pengujian Hipotesis.....	58
BAB IV	HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN	
4.1	Statistik Deskriptif	65
4.2	Hasil Pengujian Asumsi Klasik.....	69
4.3	Uji T.....	73
4.4	Pengujian Hipotesis	73
4.5	Pembahasan.....	76
BAB V	PENUTUP	
5.1	Kesimpulan.....	80
5.2	Implikasi Teoritis.....	83
5.3	Implikasi Kebijakan.....	83
5.4.	Saran.....	84
DAFTAR PUSTAKA		85