

DAFTAR ISI

| | Halaman |
|--|---------|
| HALAMAN JUDUL..... | i |
| HALAMAN PERSETUJUAN..... | ii |
| HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN | iii |
| PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI | iv |
| HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN | v |
| ABSTRACT | vi |
| ABSTRAK | vii |
| KATA PENGANTAR | viii |
| DAFTAR TABEL | xvi |
| DAFTAR GAMBAR | xvii |
| DAFTAR LAMPIRAN | xviii |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1 Latar Belakang Masalah | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 9 |
| 1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian | 10 |
| 1.3.1 Tujuan Penelitian | 10 |
| 1.3.2 Manfaat Penelitian | 11 |
| 1.4 Sistematika Penulisan | 11 |
| BAB II TELAAH PUSTAKA | 13 |
| 2.1 Landasan Teori | 13 |
| 2.1.1 Arbitrage Pricing Theory (APT) | 13 |

| | |
|--|----|
| 2.1.2 Signalling Theory | 14 |
| 2.1.3 <i>Return Saham</i> | 15 |
| 2.1.4 <i>Current Ratio (CR)</i> | 16 |
| 2.1.5 <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i> | 16 |
| 2.1.6 <i>Net Profit Margin (NPM)</i> | 16 |
| 2.1.7 <i>Return On Asset (ROA)</i> | 17 |
| 2.1.8 <i>Total Asset Turnover (TATO)</i> | 18 |
| 2.2 Penelitian Terdahulu | 18 |
| 2.3 Pengaruh Variabel Independen terhadap Variabel Independen | 21 |
| 2.3.1 Pengaruh <i>Current Ratio (CR)</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 21 |
| 2.3.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 21 |
| 2.3.3 Pengaruh <i>Net Profit Margin (NPM)</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 22 |
| 2.3.4 Pengaruh <i>Return On Asset (ROA)</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 23 |
| 2.3.5 Pengaruh <i>Total Asset Turnover (TATO)</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 23 |
| 2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis | 24 |
| 2.5 Hipotesis Penelitian | 26 |

| | |
|---|----|
| BAB III METODE PENELITIAN | 27 |
| 3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel | 27 |
| 3.1.1 Variabel Penelitian | 27 |
| 3.1.2 Definisi Operasional | 27 |
| 3.1.2.1 Variabel Dependen | 27 |
| 3.1.2.2 Variabel Independen | 28 |
| 3.2 Penentuan Populasi dan Sampel | 31 |
| 3.3 Jenis dan Sumber Data | 33 |
| 3.4 Metode Pengumpulan Data | 34 |
| 3.5 Metode Analisis Data | 34 |
| 3.5.1 Analisis Statitik Deskriptif | 34 |
| 3.5.2 Uji Asumsi Klasik | 34 |
| 3.5.2.1 Uji Multikoleniaritas | 34 |
| 3.5.2.2 Uji Autokorelasi | 35 |
| 3.5.2.3 Uji Heteroskesdatisitas | 35 |
| 3.5.2.4 Uji Normalitas | 36 |
| 3.5.3 Analisis Regresi Berganda | 37 |
| 3.5.4 Analisis Kebaikan Model | 37 |
| 3.5.4.1 Uji Kelayakan Model..... | 37 |
| 3.5.4.2 Koefisien Determinasi | 38 |
| 3.5.4.3 Uji Signifikansi Parameter Individual | 38 |
| 3.5.4.4 Uji Multikoleniaritas..... | 39 |
| 3.5.4.5 Uji Autokorelasi..... | 40 |

| | |
|---|----|
| BAB IV HASIL DAN ANALISIS | 41 |
| 4.1 Deskripsi Objek Penelitian | 41 |
| 4.1.1 Gambaran Umum Populasi dan Sampel Penelitian..... | 41 |
| 4.1.2 Statistik Deskriptif..... | 42 |
| 4.2 Uji Asumsi Klasik | 46 |
| 4.2.1 Uji Multikoleniaritas | 46 |
| 4.2.2 Uji Heteroskedastisitas | 47 |
| 4.2.3 Uji Normalitas | 49 |
| 4.2.4 Uji Autokorelasi | 52 |
| 4.3 Analisis Regresi Berganda | 52 |
| 4.3.1 Analisis Koefisien Determinasi..... | 54 |
| 4.3.2 Uji Fit Model..... | 55 |
| 4.3.3 Uji Hipotesis (Uji t)..... | 56 |
| 4.4 Pembahasan Hasil Penelitian | 58 |
| 4.4.1 Pengaruh <i>Current Ratio</i> (CR) terhadap <i>return</i> saham | 58 |
| 4.4.2 Pengaruh <i>Debt to Equiti Ratio</i> (DER) terhadap <i>return</i> saham | 59 |
| 4.4.3 Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> (NPM) terhadap <i>return</i> saham | 59 |
| 4.4.4 Pengaruh <i>Return On Asset</i> (ROA) terhadap <i>return</i> saham | 60 |
| 4.4.5 Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) terhadap <i>return</i> saham | 60 |

| | |
|---|----|
| BAB V Penutup | 62 |
| 5.1 Simpulan | 62 |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian | 63 |
| 5.3 Saran | 64 |
| 5.4 Agenda Penelitian Yang Akan Datang..... | 65 |
| DAFTAR PUSTAKA | 66 |
| LAMPIRAN-LAMPIRAN..... | 68 |