

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
ABSTRAK.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Masalah Penelitian.....	17
1.3 Tujuan Penelitian.....	19
1.4 Sistematika Penulisan.....	19
BAB II TELAAH PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori.....	21
2.1.1 Pasar Modal.....	21
2.1.2 Saham.....	22
2.1.3 Fama and French Three Factor Model.....	25
2.1.4 <i>Efficient Market Hypothesis</i>	26
2.1.5 <i>Signalling Theory</i>	31
2.1.6 <i>Return</i> saham.....	33
2.1.7 <i>Distress Risk</i>	35
2.1.8 Ukuran Perusahaan (<i>Size</i>).....	39
2.1.9 BMR (<i>Book to Market Ratio</i>).....	40
2.1.10 ROA (<i>Return on Assets</i>).....	42
2.1.11 DER (<i>Debt to Equity Ratio</i>).....	43
2.2 Penelitian Terdahulu.....	44
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	54
2.4 Hipotesis Penelitian.....	54
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1.1 Variabel Penelitian.....	64
3.1.2 Definisi Operasional.....	64
3.2.1 Variabel Independen.....	65
3.2.2 Variabel Dependen.....	68
3.2 Populasi dan Sampel.....	71
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	73
3.4.1 Jenis Data.....	73

3.4.2 Sumber Data.....	73
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	73
3.5 Teknik Analisis Data.....	74
3.5.1 Analisis Regresi Berganda.....	74
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	75
3.5.2.1 Uji Normalitas.....	75
3.5.2.2 Uji Multikolinearitas.....	76
3.5.2.3 Uji Autokorelasi.....	77
3.5.2.4 Uji Heteroskedastisitas.....	78
3.5.3 Pengujian Hipotesis.....	78
3.5.3.1 Koefisien Determinasi (R^2).....	79
3.5.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	79
3.5.3.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji T).....	80
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	
4.1 Gambaran Populasi dan Sampel.....	82
4.2 Deskripsi Statistik.....	83
4.3 Pengujian Asumsi Klasik.....	89
4.3.1 Uji Normalitas.....	89
4.3.2 Uji Multikolinearitas.....	93
4.3.3 Uji Heterokedastisitas.....	94
4.3.4 Uji Autokorelasi.....	95
4.4 Analisis Regresi.....	97
4.4.1 Uji Koefisien Determinasi.....	98
4.4.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	99
4.4.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji T).....	100
4.5 Pembahasan Hasil Penelitian.....	103
4.5.1 Pengaruh Distress risk terhadap Return saham.....	103
4.5.2 Pengaruh SIZE terhadap Return saham.....	104
4.5.3 Pengaruh BMR terhadap Return saham.....	105
4.5.4 Pengaruh ROA terhadap Return saham.....	106
4.5.5 Pengaruh DER terhadap Return saham.....	107
BAB V PENUTUP	
5.1 Kesimpulan.....	109
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	110
5.3 Saran.....	111
5.4 Implikasi Penelitian Selanjutnya.....	112
DAFTAR PUSTAKA.....	114
LAMPIRAN.....	116