

DAFTAR ISI

	Halaman
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	6
1.3.1 Tujuan Penelitian	6
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	6
1.4 Sistematika Penulisan	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Agency Theory.....	9
2.1.2 Profitabilitas	11
2.1.3 Leverage.....	12
2.1.4 Kinerja Saham.....	13
2.1.5 Risiko Sistematis	14
2.1.6 Jenis Perusahaan.....	16
2.1.7 Return Saham	17
2.2 Penelitian Terdahulu	18
2.3 Kerangka Pemikiran Penelitian.....	27
2.4 Hipotesis.....	28
2.4.1 Hubungan antara Profitabilitas dengan return saham.....	29
2.4.2 Hubungan antara Leverage dengan return saham.....	30
2.4.3 Hubungan antara Kinerja Saham dengan return saham.....	31
2.4.4 Hubungan antara Risiko Sistematis dengan return saham.....	32

2.4.5 Hubungan antara Jenis Perusahaan dengan return saham.....	33
BAB III METODE PENELITIAN.....	35
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	35
3.1.1 Variabel Penelitian.....	35
3.1.2 Definisi Operasional Variabel.....	36
3.1.2.1 Return Saham.....	36
3.1.2.2 ROA.....	37
3.1.2.3 DER.....	37
3.1.2.4 EPS.....	37
3.1.2.5 Inflasi.....	38
3.1.2.6 Jenis Perusahaan.....	38
3.2 Populasi dan Sampel.....	41
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	42
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	43
3.5 Metode Analisis.....	43
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	43
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	44
3.5.2.1 Uji Normalitas.....	44
3.5.2.2 Uji Multikolonieritas.....	44
3.5.2.3 Uji Autokorelasi.....	45
3.5.2.4 Uji Heterokedastisitas.....	45
3.5.3 Uji Hipotesis.....	45
3.5.3.1 Uji Analisis Regresi Berganda.....	46
3.5.3.2 Uji Analisis Statistik F.....	47
3.5.3.3 Uji Koefisien Determinasi.....	47

3.5.3.4 Uji Statistik T.....	48
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....	49
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	49
4.1.1 Sampel Peniltian.....	49
4.1.2 Statisitik Deskriptif.....	50
4.2 Analisis Data	52
4.2.1 Hasil Uji Asumsi Klasik	52
4.2.1.1 Uji Normalitas.....	52
4.2.1.2 Uji Multikolonieritas	54
4.2.1.3 Uji Heterokedastisitas	55
4.2.1.4 Uji Autokorelasi	56
4.2.2 Analisis Data Model Regresi Berganda.....	58
4.2.3 Overall Model Fit (Uji F).....	58
4.2.4 Koefisien Determinasi (R^2).....	59
4.2.5 Uji T.....	60
4.3 Interpretasi Hasil	62
BAB V PENUTUP.....	68
5.1 Kesimpulan	68
5.2 Keterbatasan.....	69
5.3 Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA	71