

## DAFTAR ISI

|  |             |
|--|-------------|
| <b>LEMBAR PERSRTUJUAN PEMBIMBING.....</b>                        | <b>i</b>    |
| <b>LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN.....</b>                    | <b>ii</b>   |
| <b>SURAT PERNYATAAN .....</b>                                    | <b>iii</b>  |
| <b>ABSTRAK .....</b>   | <b>iv</b>   |
| <b>ABSTRACT .....</b>  | <b>v</b>    |
| <b>KATA PENGANTAR.....</b>                                       | <b>vi</b>   |
| <b>DAFTAR ISI.....</b>   | <b>x</b>    |
| <b>DAFTAR TABEL .....</b>  | <b>xiii</b> |
| <b>DAFTAR GAMBAR.....</b>  | <b>xiv</b>  |
| <b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>                                     | <b>xv</b>   |
| <b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>                                    | <b>1</b>    |
| 1.1 Latar Belakang .....   | 1           |
| 1.2 Identifikasi Masalah .....                                   | 15          |
| 1.3 Batasan Masalah.....   | 16          |
| 1.4 Rumusan Masalah .....  | 16          |
| 1.5 Tujuan Penelitian.....                                       | 17          |
| 1.6 Manfaat Penelitian.....                                      | 17          |
| <b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....</b>                             | <b>19</b>   |
| 2.1 Landasan Teori .....   | 19          |
| 2.1.1 Teori Sinyal (Signalling Theory) .....                     | 19          |
| 2.1.2 <i>Return</i> Saham .....                                  | 20          |
| 2.1.3 Profitabilitas .....                                       | 24          |
| 2.1.4 Likuiditas .....   | 27          |
| 2.1.5 Solvabilitas.....  | 31          |
| 2.1.6 Ukuran Perusahaan.....                                     | 36          |
| 2.2 Penelitian Terdahulu.....                                    | 38          |
| 2.3 Kerangka berfikir .....                                      | 45          |
| 2.3.1 Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham ..... | 45          |
| 2.3.2 Pengaruh Likuiditas Terhadap <i>Return</i> Saham.....      | 46          |

|  |   |           |
|--|---|-----------|
| 2.3.3                                      | Pengaruh Solvabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> .....      | 47        |
| 2.3.4                                      | Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> ..... | 48        |
| 2.4  | Hipotesis .....   | 49        |
| <b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b> |   | <b>51</b> |
| 3.1  | Lokasi dan Waktu Penelitian.....                              | 51        |
| 3.2  | Populasi dan Sampel Penelitian .....                          | 51        |
| 3.2.1                                      | Populasi Penelitian .....                                     | 51        |
| 3.2.2                                      | Sampel Penelitian.....  | 52        |
| 3.3  | Variabel Penelitian dan Definisi Opersional .....             | 52        |
| 3.3.1                                      | Variabel Penelitian .....                                     | 52        |
| 3.3.2                                      | Definisi Operasional.....                                     | 53        |
| 3.4  | Teknik Pengumpulan Data .....                                 | 56        |
| 3.5  | Teknik Analisis Data .....                                    | 56        |
| 3.5.1                                      | Statistik deskriptif .....                                    | 56        |
| 3.5.2                                      | Pengujian Asumsi Klasik .....                                 | 57        |
| 3.5.3                                      | Pengujian Regresi Linier Berganda .....                       | 60        |
| 3.5.4                                      | Uji Hipotesis .....   | 60        |
| <b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>   |   | <b>63</b> |
| 4.1  | Hasil Penelitian.....   | 63        |
| 4.1.1                                      | Gambaran Sampel Penelitian .....                              | 63        |
| 4.2  | Analisa Data .....  | 66        |
| 4.2.1                                      | Analisis Statistik Deskriptif .....                           | 66        |
| 4.2.2                                      | Uji Asumsi Klasik.....  | 68        |
| 4.2.3                                      | Analisi Regresi Linear Berganda .....                         | 75        |
| 4.3  | Uji Hipotesis.....  | 77        |
| 4.3.1                                      | Hasil Uji Parsial (Uji t) .....                               | 77        |
| 4.3.2                                      | Uji Simultan (Uji f).....                                     | 80        |
| 4.3.3                                      | Koefesien Determinasi ( $R^2$ ) .....                         | 82        |
| 4.4  | Pembahasan Hasil Penelitian.....                              | 82        |
| 4.4.1                                      | Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> .....    | 82        |
| 4.4.2                                      | Pengaruh Likuiditas Terhadap <i>Return Saham</i> .....        | 84        |

|                       |   |           |
|-----------------------|---|-----------|
| 4.4.3                 | Pengaruh Solvabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> .....  | 86        |
| 4.4.4                 | Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> .....   | 88        |
| 4.4.5                 | Pengaruh Profitabilitas, Likuiditas, Solvabilitas dan Ukuran<br>Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> ..... | 89        |
| <b>BAB V</b>          | <b>PENUTUP</b> .....  | <b>91</b> |
| 5.1                   | Kesimpulan.....   | 91        |
| 5.2                   | Saran .....   | 92        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA</b> | .....   | <b>94</b> |
| <b>LAMPIRAN</b>       | .....   | <b>97</b> |

