DAFTAR ISI

ABSTRAK ..... **i**

ABSTRACT ..... **ii**

KATA PENGANTAR ..... **iii**

DAFTAR ISI ..... **vi**

DAFTAR GAMBAR ..... **ix**

DAFTAR TABEL ..... **x**

BAB 1 PENDAHULUAN **1**

1.1 Latar Belakang Masalah 1

1.2 Identifikasi Masalah 7

1.3 Pembatasan Masalah 8

1.4 Rumusan Masalah 8

1.5 Tujuan Penelitian 8

1.6 Manfaat Penelitian 9

BAB II KAJIAN PUSTAKA **10**

2.1 Kerangka Teori 10

2.1.1 Pasar Modal 10

2.1.2 *Signaling Theory* 11

2.1.3 Saham 13

2.1.3.1 Pengertian Saham 13

2.1.3.2 Jenis Saham 14

2.1.3.3 Manfaat dan Resiko kepemilikan Saham 16

2.1.3.4 Harga Saham 18

2.1.3.5 *Return* Saham 19

2.1.4 Analisis Fundamental 21

2.1.5 Kinerja 22

2.1.5.1 Kinerja Keuangan 24

2.1.5.2 Pengukuran Kinerja Keuangan 25

2.2 Peneliti Terdahulu 34

2.3 Kerangka Berpikir 37

2.4 Hipotesis 40

BAB III METODOLOGI PENELITIAN 41

3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian 41

3.2 Populasi dan Sampel 41

3.3 Jenis dan Sumber Data 42

3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional 42

3.4.1 Variabel Penelitian 42

3.4.2 Definisi Operasional 43

3.5 Teknik Pengumpulan Data 45

3.6 Teknik Analisis Data 46

3.6.1 Uji Normalitas 46

3.6.2 Uji Asumsi klasik 46

3.6.2.1 Uji Multikolenearitas 46

3.6.2.2 Uji Heteroskedastisitas 46

3.6.2.3 Uji Autokorelasi 47

3.7 Pengujian Hipotesis 48

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN 50

4.1 Hasil Penelitian 50

4.1.1 Gambaran Sampel 50

4.1.2 Uji Normalitas 52

4.1.2 Uji Asumsi Klasik 53

4.1.2.1 Uji Multikoleanearitas 53

4.1.2.2 Uji Heteroskedastisitas 54

4.1.2.3 Uji Autokorelasi 55

4.1.4 Analisis Regresi Berganda 56

4.1.5 Pengujian Hipotesis 58

4.1.6 Koefesien Determinasi 59

4.2 Pembahasan Hasil penelitian 60

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 64

5.1 Kesimpulan 64

5.2 Saran 65

DAFTAR PUSTAKA .....

LAMPIRAN