

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	27
1.3 Tujuan Penelitian	29
1.4 Manfaat Penelitian	30
1.4.1 Manfaat Teoritis.....	30
1.5 Sistematika Penulisan	32
BAB II TELAAH PUSTAKA.....	34
2.1 Landasan Teori.....	34
2.1.1 <i>Efficient Market Hypothesis</i> (Hipotesis Pasar Efisien)	34
2.1.2 <i>Behavioral Finance Theory</i> (Teori Perilaku Keuangan).....	36
2.1.3 <i>Signaling Theory</i> (Teori Sinyal).....	37
2.1.4 <i>Value Relevance Theory</i> (Teori Relevansi Nilai)	39
2.2 Definisi Variabel	42
2.3 Penelitian Terdahulu	51
2.4 Kerangka Pemikiran	64
2.5 Pengembangan Hipotesis.....	65
2.5.1 Pengaruh <i>Price to Earnings (P/E) Ratio</i> terhadap <i>Stock Return</i>	65
2.5.2 Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap <i>Stock Return</i>	68
2.5.3 Pengaruh <i>Institutional Ownership</i> terhadap <i>Stock Return</i>	72
2.6 Hipotesis Penelitian	75
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	78

3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	78
3.1.1 Variabel Penelitian	78
3.1.2 Definisi Operasional Variabel	81
3.2 Populasi dan Sampel.....	82
3.2.1 Populasi	82
3.2.2 Sampel	83
3.3 Jenis dan Sumber Data	84
3.4 Metode Pengumpulan Data	84
3.5 Metode Analisis Data.....	85
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	86
3.5.2 Uji Korelasi (Pearson)	87
3.5.3 Uji Asumsi Klasik.....	88
3.5.4 Analisis Regresi Data Panel.....	91
3.5.5 Uji Hipotesis	96
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	101
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	101
4.2 Hasil Penelitian.....	103
4.2.1 Statistik Deskriptif.....	104
4.2.2 Uji Korelasi (Pearson)	107
4.2.3 Uji Spesifikasi Model	109
4.2.4 Uji Asumsi Klasik.....	114
4.2.5 Hasil Analisis Regresi.....	124
4.2.6 Hasil Uji Hipotesis.....	136
4.3 Interpretasi Hasil.....	155
4.3.1 Pengaruh <i>Price to Earnings Ratio</i> (PER) terhadap <i>Stock Return</i>	155
4.3.2 Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) terhadap <i>Stock Return</i>	159
4.3.3 Pengaruh <i>Institutional Ownership</i> (IO) terhadap <i>Stock Return</i>	164
BAB V PENUTUP.....	170
5.1 Kesimpulan.....	170
5.2 Keterbatasan	174
5.3 Saran	175
5.3.1 Bagi Investor.....	175
5.3.2 Bagi Perusahaan.....	177
5.3.3 Bagi Akademisi.....	178
5.3.4 Bagi Penelitian Selanjutnya	180
DAFTAR PUSTAKA	182
LAMPIRAN.....	187