DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL i

HALAMAN PERSETUJUAN ii

HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN iii

PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI iv

MOTTO DAN PERSEMBAHAN v

ABSTRACT vi

ABSTRAKSI vii

KATA PENGANTAR viii

DAFTAR TABEL xiv

DAFTAR GAMBAR xv

DAFTAR LAMPIRAN xvi

BAB I PENDAHULUAN 1

1.1. Latar Belakang 1

1.2. Rumusan Masalah 10

1.3. Tujuan dan Kegunaan Penelitian 12

1.3.1 Tujuan Penelitian 12

1.3.2 Kegunaan Penelitian 12

1.4. Sistematika Penulisan 13

BAB II TINJAUAN PUSTAKA 16

2.1. Landasan Teori 16

2.1.1 *Return* Saham 16

2.1.2 Rasio Solvabilitas (*Leverage*) 18
2.1.3 Rasio Likuiditas 20
2.1.4 Rasio Pasar (*Market Ratio*)..... 22
2.1.5 Rasio Aktivitas 24
2.1.6 Rasio Profitabilitas 25
2.1.7 Kinerja Keuangan 27
2.1.8 Teori Struktur Modal 32
2.2. Penelitian Terdahulu 41
2.3. Kerangka Pemikiran..... 47
2.4. Hipotesis..... 50
BAB III METODE PENELITIAN 52
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional..... 52
3.1.1 Variabel Dependen..... 52
3.1.2 Variabel Independen 53
3.2. Populasi dan Sampel 57
3.2.1 Populasi 57
3.2.2 Sampel..... 57
3.3. Jenis dan Sumber Data 58
3.3.1 Jenis Data 58
3.3.2 Sumber Data..... 58
3.4. Metode Pengumpulan Data..... 58
3.5. Metode Analisis Data..... 59
3.5.1 Pengujian Asumsi Klasik..... 59
3.5.2 Analisis Regresi Berganda..... 63
3.5.3 Pengujian Hipotesis 64
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN 68
4.1. Deskriptif Obyek Penelitian..... 68
4.1.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian 68
4.1.2 Deskriptif Statistik Variabel Penelitian..... 71
4.2. Analisis Data 78

4.2.1 Uji Asumsi Klasik 78
4.3. Pengujian Hipotesis 90
4.3.1 Analisis Koefisien Determinasi 90
4.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji F) 92
4.3.3 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t) 93
4.4. Pembahasan Hasil Penelitian 96
4.4.1 Pengujian Hipotesis I 97
4.4.2 Pengujian Hipotesis II 98
4.4.3 Pengujian Hipotesis III 99
4.4.4 Pengujian Hipotesis IV 100
4.4.5 Pengujian Hipotesis V 102
BAB V PENUTUP 104
5.1. Kesimpulan 104
5.2. Saran 107
5.3.1 Implikasi Kebijakan 107
5.3.2 Saran Penelitian Mendatang 108
5.3. Keterbatasan Penelitian 109
DAFTAR PUSTAKA 111
LAMPIRAN-LAMPIRAN 114

FEB UNDIP