

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iii
LEMBAR ORISINALITAS	ivi
LEMBAR PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	vi
ABSTRAK	vi
<i>ABSTRACT</i>	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Pertanyaan Penelitian	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	8
1.4.1 Manfaat Teoritis	8
1.4.2 Manfaat Praktis	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	9
2.1. Teori Pendukung.....	9
2.1.1 Teori Sinyal (<i>Signalling theory</i>).....	9
2.1.2 Teori Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficiency Market Hypothesis</i>).....	10

2.1.3 Harga Saham	12
2.1.4 <i>Return</i> Saham	13
2.1.5 Rasio Nilai Pasar.....	14
2.1.6 Rasio Profitabilitas	16
2.1.7 <i>Firm Size</i>	17
2.1.8 <i>Firm Age</i>	18
2.2 Kerangka Teori dan Pengembangan Hipotesis.....	20
2.2.1 Tinjauan Hasil Penelitian Terdahulu	20
2.2.2 Kerangka Teori.....	25
2.2.3 Pengembangan Hipotesis.....	28
BAB III METODE PENELITIAN	30
3.1 Unit Analisis, Populasi Dan Sampel.....	30
3.2 Teknik Pengumpulan Data	31
3.3 Operasional Variabel	31
3.4 Teknik Analisis Data.....	36
3.4.1 Statistik Deskriptif.....	36
3.4.2 Analisis Regresi Data Panel	37
3.4.3 Uji Asumsi Klasik.....	40
3.4.4 Uji Hipotesis.....	41
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	43

4.1 Deskripsi Data	43
4.1.1 Hasil Pemilihan Sampel.....	43
4.1.2 Statistik Deskriptif.....	44
4.2 Hasil.....	50
4.2.1 Pemilihan Model Regresi	50
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	53
4.2.3 Regresi Data Panel.....	57
4.2.4 Uji Hipotesis Regresi Data Panel	63
4.3 Pembahasan	69
4.3.1 Pengaruh Rasio Nilai Pasar Terhadap Harga Saham.....	69
4.3.2 Pengaruh Rasio Nilai Pasar terhadap <i>Return</i> Saham	72
4.3.3 Pengaruh Rasio Profitabilitas Terhadap Harga Saham	74
4.3.4 Pengaruh Rasio Profitabilitas Terhadap <i>Return</i> Saham.....	76
4.3.5 Pengaruh Variabel Kontrol Terhadap Harga Dan <i>Return</i> Saham	76
BAB V PENUTUP	83
5.1 Kesimpulan.....	83
5.2 Implikasi.....	84
5.2.1 Implikasi Teoritis	84
5.2.2 Implikasi Praktis	85
5.3 Keterbatasan Penelitian	86

5.4 Rekomendasi Bagi Penelitian Selanjutnya.....	87
DAFTAR PUSTAKA.....	88
LAMPIRAN.....	94

