

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah	7
C. Pembatasan Masalah	8
D. Perumusan Masalah	8
E. Kegunaan Penelitian	9
BAB II KAJIAN TEORETIK	11
A. Deskripsi Konseptual	11
1. Teori Sinyal	11
2. <i>Return Saham</i>	13
3. <i>Equity Risk Premium</i>	15
4. Ukuran Perusahaan	20
5. Volatilitas Pasar	22

6. <i>Earning per Share</i>	26
7. <i>Leverage</i>	28
B. Hasil Penelitian yang Relevan	31
C. Kerangka Teoretik.....	38
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	40
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	46
A. Tujuan Penelitian	46
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	46
C. Metode Penelitian	47
D. Populasi dan Sampel	47
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	48
F. Teknik Analisis Data.....	53
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	65
A. Deskripsi Data.....	65
1. Hasil Pemilihan Sampel.....	65
2. Statistika Deskriptif.....	67
B. Pengujian Hipotesis.....	74
1. Pemilihan Model Regresi	74
2. Uji Asumsi Klasik	75
3. Analisis Regresi Linear Berganda.....	79
4. Pengujian Kelayakan Model (<i>Goodness of Fit</i>).....	82
5. Pengujian Hipotesis	84
C. Pembahasan	86

BAB V	KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN.....	98
A.	Kesimpulan.....	98
B.	Implikasi.....	99
C.	Saran.....	100
DAFTAR PUSTAKA.....		102
LAMPIRAN.....		105
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....		134

DAFTAR TABEL

Tabel II.1.	Hasil Penelitian yang Relevan.....	34
Tabel IV.1.	Kriteria Pemilihan Sampel.....	66
Tabel IV.2.	Hasil Statistika Deskriptif	68
Tabel IV.3.	Hasil <i>Redundant Fixed Test</i>	74
Tabel IV.4.	Hasil Uji Korelasi	77
Tabel IV.5.	Hasil White Test	78
Tabel IV.6.	Hasil Durbin Watson.....	79
Tabel IV.7.	Hasil Regresi Linear Berganda (<i>Pooling Least Square</i>)	80
Tabel IV.8.	Hasil Uji Koefisien Determinasi	83
Tabel IV.9.	Hasil Uji Statistik t	84
Tabel IV.10.	Pembuktian Hipotesis 1	87
Tabel IV.11.	Pembuktian Hipotesis 2.....	90
Tabel IV.12.	Pembuktian Hipotesis 3	92
Tabel IV.13.	Pembuktian Hipotesis 4	96

DAFTAR GAMBAR

Gambar II.1. Kerangka Pemikiran	40
Gambar IV.1. Hasil Uji Normalitas	76

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Kartu Konsultasi Pembimbingan Penulisan Skripsi	105
Lampiran 2	Perusahaan Sampel Penelitian	106
Lampiran 3	Ringkasan Perhitungan Variabel Dependen dan Variabel Independen Sebelum Transformasi Data dan <i>Outlier</i>	107
Lampiran 4	Ringkasan Perhitungan Variabel Dependen dan Independen Setelah Transformasi Data dan <i>Outlier</i>	109
Lampiran 5	Hasil Perhitungan <i>Equity Risk Premium</i>	111
Lampiran 6	Hasil Perhitungan Ukuran Perusahaan	113
Lampiran 7	Hasil Perhitungan Volatilitas Pasar	115
Lampiran 8	Hasil Perhitungan <i>Earning Per Share</i>	117
Lampiran 9	Hasil Perhitungan <i>Leverage</i>	119
Lampiran 10	Contoh Data Sumber Total Aset	121
Lampiran 11	Contoh Data Sumber Total Liabilitas	122
Lampiran 12	Contoh Data Sumber <i>Earning Per Share</i>	123
Lampiran 13	<i>Casewise Diagnostic</i> dan <i>Leverage Plots</i>	124
Lampiran 14	Hasil Analisis Statistik Deskriptif	127
Lampiran 15	Hasil Pengujian Pemilihan Model dengan <i>Redundant Test</i>	128
Lampiran 16	Hasil Pengujian dengan Model <i>Pooling Least Square</i>	129
Lampiran 17	Hasil Uji Normalitas	130
Lampiran 18	Hasil Uji Multikolinearitas	131
Lampiran 19	Hasil Uji Heterokedastisitas dengan Uji <i>White</i>	132
Lampiran 20	Hasil Uji Autokorelasi	133