

## DAFTAR ISI

ABSTRAK.....	i
ABSTRACT.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	9
2.1 <i>Signalling Theory</i> .....	9
2.2 Indeks KOMPAS100.....	10

2.3	<i>Return Saham</i> .....	10
2.4	Kinerja Keuangan.....	11
2.5	<i>Price Earning Ratio (PER)</i> .....	14
2.6	<i>Earning Per Share (EPS)</i> .....	16
2.7	<i>Price to Book Value (PBV)</i> .....	17
2.8	Hasil Penelitian Yang Relevan.....	18
2.9	Kerangka Pemikiran.....	32
2.10	Perumusan Hipotesis Penelitian.....	37
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		38
3.1	Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	38
3.2	Metode Penelitian.....	38
3.3	Sumber Data, Populasi, dan Sampel.....	39
3.3.1	Sumber Data.....	39
3.3.2	Populasi.....	40
3.3.3	Sampel.....	40
3.4	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	42
3.5	Teknik Pengumpulan Data.....	43
3.6	Teknik Analisis Data.....	44
3.6.1	Statistik Deskriptif.....	44
3.6.2	Uji Asumsi Klasik.....	45

3.6.2.1	Uji Multikolinearitas.....	45
3.6.3	Uji Regresi Data Panel.....	46
3.6.3.1	Model Estimasi Regresi Data Panel.....	48
3.6.3.2	Uji Model Estimasi Regresi Data Panel.....	49
3.6.4	Uji Hipotesis.....	52
3.6.4.1	Uji Signifikansi Parsial (Uji <i>t</i> ).....	53
3.6.5	Uji Koefisien Determinasi.....	53
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		55
4.1	Hasil Penelitian.....	55
4.1.1	Statistik Deskriptif.....	55
4.1.2	Uji Asumsi Klasik.....	67
4.1.2.1	Uji Multikolinearitas.....	67
4.1.3	Uji Regresi Data Panel.....	68
4.1.3.1	Uji <i>Chow</i> .....	68
4.1.3.2	Uji <i>Hausman</i> .....	70
4.1.3.3	Uji <i>Lagrange Multiplier</i> .....	71
4.1.4	Uji Hipotesis.....	75
4.1.4.1	Uji Signifikansi Parsial (Uji <i>t</i> ).....	75
4.1.5	Uji Koefisien Determinasi.....	76
4.2	Pembahasan.....	77

BAB V	KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN.....	82
5.1	Kesimpulan.....	82
5.2	Implikasi.....	83
5.3	Saran.....	84
	DAFTAR PUSTAKA.....	86
	LAMPIRAN.....	90
	RIWAYAT HIDUP.....	109

## DAFTAR TABEL

Tabel II-1	Matriks Hasil Penelitian yang Relevan.....	30
Tabel III-1	Teknik Pengambilan Sampel.....	41
Tabel III-2	Operasional Variabel Penelitian.....	42
Tabel IV-1	Hasil Statistik Deskriptif.....	55
Tabel IV-2	Hasil Uji Multikolinearitas.....	67
Tabel IV-3	Hasil Uji <i>Chow</i> .....	69
Tabel IV-4	Hasil Uji <i>Hausman</i> .....	70
Tabel IV-5	Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier</i> .....	72
Tabel IV-6	Hasil Regresi Data Panel – <i>Common Effect Model</i> .....	73
Tabel IV-7	Hasil Uji Signifikansi Parsial (Uji t).....	76
Tabel IV-8	Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	77

## DAFTAR GAMBAR

Gambar II-1	Kerangka Pemikiran.....	32
-------------	-------------------------	----

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Teknik Pengambilan Sampel.....	90
Lampiran 2	Data Sampel Penelitian.....	94
Lampiran 3	Data Variabel Penelitian Periode 2015-2018.....	94
Lampiran 4	Data <i>Return</i> Saham Periode 2015.....	97
Lampiran 5	Data <i>Return</i> Saham Periode 2016.....	97
Lampiran 6	Data <i>Return</i> Saham Periode 2017.....	98
Lampiran 7	Data <i>Return</i> Saham Periode 2018.....	99
Lampiran 8	Data PER, EPS, dan PBV Periode 2015.....	100
Lampiran 9	Data PER, EPS, dan PBV Periode 2016.....	101
Lampiran 10	Data PER, EPS, dan PBV Periode 2017.....	102
Lampiran 11	Data PER, EPS, dan PBV Periode 2018.....	103
Lampiran 12	<i>Output</i> Statistik Deskriptif.....	104
Lampiran 13	<i>Output Common Effect Model</i> .....	104
Lampiran 14	<i>Output Fixed Effect Model</i> .....	105
Lampiran 15	<i>Output Random Effect Model</i> .....	105
Lampiran 16	<i>Output Uji Chow</i> .....	106
Lampiran 17	<i>Output Uji Hausman</i> .....	107
Lampiran 18	<i>Output Uji Lagrange Multiplier</i> .....	108
Lampiran 19	<i>Output Uji Multikolinearitas</i> .....	108