

## DAFTAR ISI

**LEMBAR PERSETUJUAN**

**MOTTO**

**BIOGRAFI**

**ABSTRAK**

**KATA PENGANTAR.....i**

**DAFTAR ISI.....iv**

**DAFTAR TABEL .....viii**

**DAFTAR GAMBAR.....ix**

**BAB I PENDAHULUAN.....1**

A. Latar Belakang Penelitian .....1

B. Identifikasi Penelitian.....9

C. Rumusan Masalah.....10

D. Tujuan Penelitian .....11

E. Manfaat Hasil Penelitian .....11

F. Kerangka Pemikiran.....12

G. Hipotesis.....17

**BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....18**

A. Pasar Modal .....18

1. Pengertian Pasar Modal.....18

2. Peranan Pasar Modal.....19

3. Fungsi Pasar Modal.....	20
B. Laporan Keuangan.....	21
1. Pengertian Laporan Keuangan.....	21
C. Rasio Keuangan.....	22
1. Pengertian Rasio Keuangan.....	22
2. Jenis-jenis Rasio Keuangan.....	23
3. Tingkat Pengembalian Aset (ROA).....	27
4. Rasio Lancar (CR).....	29
D. Return Saham.....	32
1. Pengertian Return Saham.....	32
2. Faktor –faktor yang Mempengaruhi Return Saham.....	34
E. Penelitian Terdahulu.....	36
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....</b>	<b>39</b>
A. Metode Penelitian.....	39
B. Objek Penelitian.....	41
C. Desain Penelitian.....	42
D. Jenis Data.....	44
E. Variabel Penelitian dan Operasional Variabel.....	46
F. Sumber dan Teknik Penentuan Data.....	50
1. Sumber Data.....	50
2. Teknik Penentuan Data.....	51
a. Populasi.....	51

b. Sampel .....	51
G. Teknik Pengumpulan Data .....	52
H. Teknik Analisis Data.....	53
1. Analisis Deskriptif.....	54
2. Analisis Verifikatif.....	55
3. Analisis Regresi Linear Berganda.....	56
I. Teknik Pengolahan Data .....	57
1. Pemilihan Model.....	57
2. Teknik Estimasi Regresi Data Panel .....	58
J. Pengujian Hipotesis.....	59
a. Uji Parsial (Uji t) .....	59
b. Uji Simultan (Uji F) .....	60
c. Uji Koefisien Determinasi.....	61
K. Tempat dan Waktu Penelitian.....	63
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>65</b>
A. Gambaran Umum Perusahaan .....	65
1. Profil Perusahaan .....	68
2. Perkembangan Nilai ROA Perusahaan.....	72
3. Perkembangan Nilai CR Perusahaan.....	74
4. Perkembangan Return Saham Perusahaan .....	76
B. Teknik Analisis .....	77
1. Analisis Deskriptif .....	77

C. Pemilihan Model.....	79
1. Model Efek Tetap ( <i>Fixed Effect Model</i> ).....	79
2. Model Random Efek ( <i>Random Effect Model</i> ) .....	80
D. Regresi Data Panel.....	81
1. Uji Hausman .....	81
2. Regresi Linier Berganda.....	82
E. Pengujian Hipotesis.....	83
1. Uji Parsial ( <i>t-Test</i> ) .....	83
2. Uji Simultan ( <i>F-Test</i> ) .....	86
3. Koefisien Determinasi .....	87
F. Pembahasan Hasil Penelitian.....	88
<b>V. PENUTUP .....</b>	<b>90</b>
A Kesimpulan.....	90
B Saran.....	91
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>98</b>
<b>LAMPIRAN</b>	

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Nilai ROA, CR dan Return Saham Tiga Perusahaan.....	6
Tabel 3.1 Desain Penelitian .....	43
Tabel 3.2 Data ROA, CR dan Return Saham Tiga Perusahaan .....	45
Tabel 3.3 Operasional Variabel.....	48
Table 3.4 Tabel Koefisien Determinasi.....	62
Tabel 3.5 Waktu Penelitian.....	64
Table 4.1 Perkembangan Nilai ROA.....	73
Table 4.2 Perkembangan Nilai CR.....	74
Table 4.3 Perkembangan Nilai Return Saham.....	76
Table 4.4 Deskriptif Statistik Data Panel .....	79
Table 4.5 <i>Fixed Effect Model</i> .....	80
Table 4.6 <i>Random Effect Model</i> .....	81
Table 4.7 Uji Hausman.....	82
Table 4.8 Regresi Linier Berganda.....	83
Table 4.9 Uji t ( <i>t-Test</i> ) .....	84
Table 4.10 Uji f ( <i>f-Test</i> ) .....	86
Table 4.11 Koefisien Determinasi .....	87

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. Kerangka Pemikiran ..... 17

