

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL i

HALAMAN PENGESAHAN..... ii

HALAMAN PERSETUJUAN..... iii

HALAMAN PERNYATAAN iv

HALAMAN MOTTO.....v

HALAMAN PERSEMBAHAN..... vi

KATA PENGANTAR vii

ABSTRAK ix

DAFTAR ISIx

DAFTAR TABEL xiii

DAFTAR GAMBAR.....xiv

BAB I PENDAHULUAN

 A. Latar Belakang.....1

 B. Rumusan Masalah.....8

 C. Tujuan Penelitian8

 D. Manfaat Penelitian8

 E. Sistematika Penulisan9

BAB II LANDASAN TEORI

 A. Deskripsi Teori10

 1. *Signaling Theory*10

 2. Pasar Modal.....11

 3. Indeks Harga Saham.....13

 4. Return Saham14

 5. Faktor Fundamental.....19

 6. *Return On Asset (ROA)*22

 7. *Debt to Equity Ratio (DER)*.....24

 8. *Earning Per Share (EPS)*27

 B. Penelitian Terdahulu29

 C. Hipotesis Penelitian33

 D. Kerangka Berfikir34

BAB III METODE PENELITIAN

 A. Jenis dan Pendekatan35

 B. *Setting* Penelitian35

 C. Populasi dan Sampel36

 D. Desain dan Definisi Operasional.....37

E. Teknik Pengumpulan Data40

F. Teknik Analisis Data.....42

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Hasil Penelitian55

1. Gambaran Objek Penelitian55

2. Analisis Data58

1) Estimasi Model Regresi Data Panel58

2) Pemilihan Model Model Regresi63

3) Ikhtisar Pemilihan Model Akhir68

4) Uji Asumsi Klasik69

5) Uji Hipotesis74

B. Pembahasan Hasil Penelitian77

1. Pengaruh *Return On Asset* (ROA) terhadap
Return Saham77

2. Pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap
Return Saham79

3. Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) terhadap
Return Saham80

BAB V PENUTUP

A. Simpulan83

B. Saran84

C. Penutup85

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 7

Tabel 2.1 31

Tabel 3.1 38

Tabel 3.2 40

Tabel 3.3 50

Tabel 4.1 59

Tabel 4.2 60

Tabel 4.3 61

Tabel 4.4 62

Tabel 4.5 64

Tabel 4.6 66

Tabel 4.7 70

Tabel 4.8 71

Tabel 4.9 72

Tabel 4.10 73

Tabel 4.11 74

Tabel 4.12 75

Tabel 4.13 76

Tabel 4.14 77



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 35

Gambar 3.1 52

Gambar 3.2 54

