

DAFTAR ISI

PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR.....	i
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR.....	ii
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR	iii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Manfaat Penelitian.....	6
1.4.1 Manfaat Teoritis.....	6
1.4.2 Manfaat Praktis	7
1.5 Sistematika Penulisan.....	7
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	9

2.1	Pengaruh Informasi Fundamental Laporan Keuangan terhadap Return Saham.....	9
2.2	Nilai Perusahaan.....	14
2.3	<i>Book Value</i>	16
2.4	<i>Income</i>	16
2.5	Dividen	17
2.6	Hipotesis	20
2.6.1	<i>Book Value</i> dan Return Saham	20
2.6.2	<i>Income before extraordinary/share</i> dan Return Saham.....	21
2.6.3	<i>Negative Income</i> dan Return Saham.....	22
2.6.4	Dividen dan Return Saham.....	23
2.6.5	<i>Growth</i> dan Return Saham.....	24
BAB 3	METODE PENELITIAN	25
3.1	Data Penelitian	25
3.2	Model Empiris.....	25
3.3	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	26
3.4	Metode Analisa Data	28
3.4.1	Statistik Deskriptif.....	28
3.4.2	Regresi Data Panel.....	28
3.4.2.1	Common Effect Model	29
3.4.2.2	<i>Fixed Effect Model</i>	29

3.4.2.3	<i>Random Effect Model</i>	30
3.4.3	Pemilihan Model.....	30
3.4.3.1	Uji Chow	30
3.4.3.2	Uji Hausman.....	31
3.4.3.3	Uji Lagrange	31
3.5	Uji Asumsi Klasik	31
3.5.1	Uji Heterokedastisitas	32
3.5.2	Uji Autokorelasi.....	32
BAB 4	HASIL DAN PEMBAHASAN	33
4.1	Deskriptif Hasil Penelitian	33
4.2	Analisis	36
4.2.1	Chow Test	36
4.2.2	<i>Hausman Test</i>	37
4.2.3	Hasil Pemilihan Model	37
4.2.4	Uji Asumsi Klasik.....	38
4.2.4.1	Uji Heterokedastisitas	38
4.2.4.2	Autokorelasi	39
4.3	Pembahasan	39
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN	44
5.1	Kesimpulan.....	44
5.2	Implikasi Manajerial.....	45

5.3 Keterbatasan dan Saran Bagi Penelitian Selanjutnya.....	46
DAFTAR PUSTAKA.....	48
DAFTAR LAMPIRAN	51



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel.....	27
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif.....	34
Tabel 4.2 Frekuensi Negative Income.....	36
Tabel 4.3 Hasil Uji Chow Test.....	36
Tabel 4.4 Hasil Uji Haussman Test.....	37
Tabel 4.6 Hasil Pemilihan Model.....	37
Tabel 4.7 Uji Heterokedastisitas.....	38
Tabel 4.8 Hasil Uji Wooldridge Test.....	39
Tabel 4.10 Hasil Pengujian Hipotesis <i>General Least Square</i> (GLS).....	40

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Rata-rata Return Saham Pada Industri Manufaktur 2018-202233

