

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	I
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN TUGAS AKHIR.....	II
LEMBAR PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING.....	III
LEMBAR PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR.....	IV
ABSTRAK.....	V
ABSTRACT.....	VI
KATA PENGANTAR.....	VII
DAFTAR ISI.....	X
DAFTAR GAMBAR.....	XIII
DAFTAR TABEL.....	XIV
DAFTAR LAMPIRAN.....	XV
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Batasan Masalah.....	13
1.3. Rumusan Masalah.....	13
1.4. Tujuan Penelitian.....	14
1.5. Manfaat.....	14
1.5.1. Manfaat Teoritis.....	14
1.5.2. Manfaat Praktis.....	15
1.6. Sistematika Penulisan.....	16
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS..	17
2.1. Tinjauan Teori.....	17
2.1.1. <i>Signaling Theory</i>	17
2.1.2. <i>Return Saham</i>	18
2.1.2.1. Pengertian <i>Return Saham</i>	18
2.1.2.2. Macam-macam <i>Return Saham</i>	20
2.1.2.3. Komponen <i>Return Saham</i>	21
2.1.2.4. Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	21
2.1.2.5. Pengukuran <i>Return Saham</i>	22
2.1.3. Rasio Keuangan.....	22
2.1.4. <i>Price Earnings Ratio (PER)</i>	26
2.1.4.1. Pengertian <i>Price Earnings Ratio (PER)</i>	26
2.1.4.2. Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Price Earnings Ratio</i>	28
2.1.4.3. Pengukuran <i>Price Earnings Ratio</i>	29
2.1.5. <i>Return On Equity (ROE)</i>	29
2.1.5.1. Pengertian <i>Return On Equity (ROE)</i>	29
2.1.5.2. Tujuan dan Manfaat <i>Return On Equity (ROE)</i>	30
2.1.5.3. Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Return On Equity</i>	32
2.1.5.4. Pengukuran <i>Return On Equity</i>	33
2.1.6. <i>Return On Assets (ROA)</i>	33
2.1.6.1. Pengertian <i>Return On Assets (ROA)</i>	33
2.1.6.2. Kelebihan dan Kelemahan <i>Return On Assets (ROA)</i>	35
2.1.6.3. Kegunaan <i>Return On Assets</i>	36
2.1.6.4. Pengukuran <i>Return On Assets</i>	37

2.1.7.	<i>Dividend Yield Ratio</i>	37
2.1.7.1.	Pengertian <i>Dividend Yield Ratio</i>	37
2.1.7.2.	Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Dividend Yield</i>	39
2.1.7.3.	Pengukuran <i>Dividend Yield Ratio</i>	40
2.1.8.	<i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	41
2.1.8.1.	Pengertian <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	41
2.1.8.2.	Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	42
2.1.8.3.	Pengukuran <i>Debt to Equity Ratio</i>	43
2.1.9.	Beta.....	43
2.2.	Penelitian Terdahulu.....	46
2.3.	Pengembangan Hipotesis.....	53
2.3.1.	Pengaruh <i>Price Earnings Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	53
2.3.2.	Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	53
2.3.3.	Pengaruh <i>Return On Assets</i> terhadap <i>Return Saham</i>	54
2.3.4.	Pengaruh <i>Dividend Yield Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	55
2.3.5.	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	56
2.3.6.	Pengaruh Beta terhadap <i>Return Saham</i>	57
2.4.	Model Penelitian.....	58
2.5.	Bagan Alur Berpikir.....	59
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		61
3.1.	Jenis Penelitian.....	61
3.2.	Populasi dan Sampel.....	61
3.2.1.	Populasi.....	61
3.2.2.	Sampel.....	62
3.3.	Metode Pengumpulan Data.....	62
3.4.	Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	63
3.5.	Metode Analisa Data.....	67
3.5.1.	Uji Asumsi Klasik.....	67
3.5.2.	Metode Analisis Regresi Berganda.....	70
3.5.3.	Uji Hipotesis.....	71
BAB IV ANALISA DATA DAN PEMBAHASAN.....		73
4.1.	Gambaran Umum.....	73
4.2.	Analisa Data.....	73
4.2.1.	Analisis Kualitas Data.....	73
4.2.1.1.	Analisis Statistik Deskriptif.....	76
4.2.1.2.	Uji Asumsi Klasik.....	78
4.2.1.3.	Hasil Analisa Regresi Linier Berganda.....	84
4.2.2.	Analisis Pengujian Hipotesis.....	87
4.2.2.1.	Uji T.....	87
4.2.2.2.	Uji F.....	90
4.2.2.3.	Koefisien Determinasi.....	90
4.3.	Pembahasan.....	92
4.3.1.	Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> (PER) terhadap <i>Return Saham</i>	92
4.3.2.	Pengaruh <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>Return Saham</i>	93
4.3.3.	Pengaruh <i>Return On Assets</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i>	95
4.3.4.	Pengaruh <i>Dividend Yield Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i>	97
4.3.5.	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap <i>Return Saham</i>	99
4.3.6.	Pengaruh Beta terhadap <i>Return Saham</i>	101

BAB V KESIMPULAN.....	104
5.1. Kesimpulan.....	104
5.1.1. Simpulan Atas Hipotesis.....	104
5.1.2. Simpulan Atas Masalah Peneleitian.....	104
5.2. Implikasi.....	106
5.1.1. Implikasi Teoritis.....	106
5.1.2. Implikasi Manajerial.....	106
5.3. Rekomendasi.....	107
DAFTAR PUSTAKA.....	108
LAMPIRAN.....	116



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 <i>Return</i> Saham per Tahun Perusahaan Indeks LQ45 Tahun 2015-2021.....	4
Gambar 2.1 Model Penelitian.....	59



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Persamaan dan Perbedaan Penelitian dengan Penelitian Terdahulu....	46
Tabel 4.1 Daftar Sampel Perusahaan Dalam Indeks LQ 45.....	75
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif.....	77
Tabel 4.3 Hasil Pengujian Normalitas.....	80
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas.....	81
Tabel 4.5 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	82
Tabel 4.6 Hasil Uji Linieritas.....	83
Tabel 4.7 Hasil Uji Autokorelasi.....	85
Tabel 4.8 Hasil Analisa Regresi Linier Berganda.....	86
Tabel 4.9 Hasil Uji T.....	89
Tabel 4.10 Hasil Uji F.....	91
Tabel 4.11 Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	92



DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN A	: Daftar Data Variabel Perusahaan LQ 45.....	117
LAMPIRAN B	: Hasil Uji Statistik Program SPSS 26 For Windows.....	124
LAMPIRAN B1	: Uji Normalitas Kormogorov Smirnov.....	124
LAMPIRAN B2	: Uji Heterokedastisitas Spearman's Rho.....	126
LAMPIRAN B3	: Uji Multikolinieritas.....	127
LAMPIRAN B4	: Uji Linieritas.....	129
LAMPIRAN B5	: Uji Autokorelasi Durbin Watson.....	135
LAMPIRAN C	: Tabel Durbin Watson.....	136
LAMPIRAN D	: Tabel T.....	137
LAMPIRAN E	: Tabel F.....	144
LAMPIRAN F	: Turnitin.....	149

