

## DAFTAR ISI

JUDUL SKRIPSI .....	i
HALAMAN PENGESAHAN .....	ii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK .....	vii
ABSTRACT .....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL .....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
DAFTAR LAMPIRAN .....	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Rumusan Masalah .....	8
1.3. Tujuan Penelitian .....	9
1.4. Manfaat Penelitian .....	9
1.5. Sistematika Penulisan .....	10
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS .....	12
2.1. Landasan Teori .....	12
2.1.1. <i>Grand Theory</i> .....	12
2.1.1.1. Teori Sinyal ( <i>Singnalling Theory</i> ) .....	12

<b>1.2. Tinjauan Literatur .....</b>	<b>13</b>
2.2.1. <i>Return Saham</i> .....	13
2.2.1.1. Pengertian <i>Return</i> saham.....	13
2.2.1.2. Sumber-sumber <i>return</i> .....	15
2.2.1.3. Rumus <i>return</i> saham .....	15
2.2.1.4. Pengertian saham .....	16
2.2.1.5. Jenis-jenis saham.....	16
2.2.1.6. Faktor penyebab naik turunnya harga saham.....	17
2.2.2. <i>Return On Asset (ROA)</i> .....	18
2.2.2.1. Pengertian <i>return on asset (ROA)</i> .....	18
2.2.2.2. Rumus <i>return on asset (ROA)</i> .....	19
2.2.3. <i>Earning Per Share (EPS)</i> .....	20
2.2.3.1. Pengertian <i>earning per share (EPS)</i> .....	20
2.2.3.1. Rumus <i>earning per share (EPS)</i> .....	21
2.2.4. <i>Net Profit Margin (NPM)</i> .....	21
2.2.4.1. Pengertian <i>net profit margin (NPM)</i> .....	21
2.2.4.2. Rumus <i>net profit margin (NPM)</i> .....	22
2.2.5. Ukuran Perusahaan.....	23
2.2.5.1. Pengertian ukuran perusahaan.....	23
2.2.5.2. Rumus ukuran perusahaan .....	24

<b>1.3. Penurunan Hipotesis .....</b>	<b>24</b>
1.3.1. Pengaruh <i>Return On Asset</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	24
1.3.2. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	26
1.3.3. Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	28
<b>1.4. Kerangka Konseptual .....</b>	<b>29</b>
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>31</b>
<b>3.1. Populasi dan Sampel .....</b>	<b>31</b>
3.1.1. Populasi Penelitian .....	31
3.1.2. Sampel Penelitian .....	31
<b>3.2. Jenis dan Sumber Data .....</b>	<b>32</b>
3.2.1. Jenis Data Penelitian .....	32
3.2.2. Sumber Data Penelitian .....	33
<b>3.3. Definisi Operasional Variabel Penelitian .....</b>	<b>33</b>
3.3.1. Variabel Dependen .....	33
3.3.1.1. <i>Return Saham</i> .....	34
3.3.2. Variabel Independen .....	34
3.3.2.1. <i>Return On Asset (ROA)</i> .....	35
3.3.2.2. <i>Earning Per Share (EPS)</i> .....	35
3.3.2.3. <i>Net Profit Margin (NPM)</i> .....	35
3.3.3. Variabel Kontrol .....	36

3.3.3.1.	Ukuran Perusahaan .....	36
<b>3.4.</b>	<b>Teknik Analisis Data .....</b>	<b>37</b>
3.4.1.	Teknik Statistik Deskriptif .....	37
3.4.2.	Uji Asumsi Klasik .....	37
3.4.2.1.	Uji Normalitas .....	37
3.4.2.2.	Uji Multikolinearitas .....	38
3.4.2.3.	Uji Autokorelasi .....	39
3.4.2.4.	Uji Heterokedastisitas .....	40
<b>3.5.</b>	<b>Pengujian Hipotesis .....</b>	<b>40</b>
3.5.1.	Analisis Regresi Linier Berganda .....	40
3.5.2.	Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	42
3.5.3.	Uji Signifikan Simultan (Uji F) .....	42
3.5.4.	Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t) .....	43
<b>BAB IV</b>	<b>ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>44</b>
<b>4.1.</b>	<b>Deskripsi Sampel Penelitian .....</b>	<b>44</b>
<b>4.2.</b>	<b>Hasil Uji Statistik Deskriptif .....</b>	<b>47</b>
<b>4.3.</b>	<b>Hasil Uji Asumsi Klasik .....</b>	<b>48</b>
4.3.1.	Hasil Uji Normalitas .....	48
4.3.2.	Hasil Uji Multikolinearitas .....	53
4.3.3.	Hasil Uji Autokorelasi .....	54

4.3.4. Hasil Uji Heterokedastisitas.....	55
<b>4.4. Hasil Pengujian Hipotesis.....</b>	<b>56</b>
4.4.1. Hasil Uji Signifikan Simultan (Uji F) .....	56
4.4.2. Hasil Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t).....	57
4.4.3. Hasil Uji Koefisien determinasi ( $R^2$ ) .....	58
4.4.4. Hasil Analisis Regresi Berganda.....	58
<b>4.5. Pembahasan Hasil .....</b>	<b>61</b>
4.5.1. Pengaruh <i>Return on Asset</i> (ROA) terhadap <i>Return Saham</i> .....	61
4.5.2. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap <i>Return Saham</i> .....	62
4.5.3. Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> (NPM) terhadap <i>Return Saham</i> .....	63
4.5.4. Pengaruh Ukuran Perusahaan sebagai Variabel Kontrol terhadap <i>Return Saham</i> .....	64
<b>BAB V PENUTUP.....</b>	<b>65</b>
<b>5.1. Kesimpulan .....</b>	<b>65</b>
<b>5.2. Implikasi hasil Penelitian .....</b>	<b>65</b>
<b>5.3. Keterbatasan Penelitian.....</b>	<b>66</b>
<b>5.4. Saran .....</b>	<b>67</b>
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>68</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>73</b>

## DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1	Deskripsi Pengambilan Sampel .....	45
Tabel 4. 2	Daftar Sampel Perusahaan <i>Food and Beverage</i> .....	45
Tabel 4. 3	Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	47
Tabel 4. 4	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> Per Variabel Sebelum <i>Outlier</i> .....	49
Tabel 4. 5	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> <i>Unstandardized Residual</i> Sebelum <i>Outlier</i> .....	50
Tabel 4. 6	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> Per Variabel Setelah <i>Outlier</i> .....	50
Tabel 4. 7	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> <i>Unstandardized Residual</i> Setelah <i>Outlier</i> .....	51
Tabel 4. 8	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> Per Variabel Setelah <i>Outlier-Transform</i> .....	51
Tabel 4. 9	Hasil Uji Normalitas <i>One- Sample Kolmogov- Smirnov</i> <i>Unstandardized Residual</i> Setelah <i>Outlier-Transform</i> .....	52
Tabel 4. 10	Hasil Uji Multikolinearitas.....	53
Tabel 4. 11	Hasil Uji Autokorelasi .....	54
Tabel 4. 12	Hasil Uji Heterokedastisitas.....	55
Tabel 4. 13	Hasil Uji Signifikan Simultan (Uji F) .....	56
Tabel 4. 14	Hasil Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t).....	57
Tabel 4. 15	Hasil Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	58

Tabel 4. 16 Hasil Analisis Linier Berganda .....	59
--	----

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 <i>Return</i> saham perusahaan <i>food and beverage</i> .....	3
Gambar 2. 1 Kerangka Konsep .....	30



## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Uji Statistik Deskriptif.....	73
Lampiran 2 Uji Normalitas Sebelum <i>outlier</i> .....	73
Lampiran 3 Uji Normalitas Setelah <i>Outlier</i> .....	74
Lampiran 4 Uji Normalitas Setelah <i>Outlier-Transform</i> .....	75
Lampiran 5 Uji Normalitas Setelah <i>Outlier-Transform</i> .....	75
Lampiran 6 Uji Multikolinearitas .....	76
Lampiran 7 Uji Autokorelasi .....	76
Lampiran 8 Uji Heterokedastisitas.....	77
Lampiran 9 Uji Regresi Linier Berganda.....	77
Lampiran 10 Uji koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	77
Lampiran 11 Uji Signifikan Simultan (Uji F).....	78
Lampiran 12 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t).....	78
Lampiran 13 Tabulasi Data Penelitian.....	79