

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK .....	vii
<i>ABSTRACT</i> .....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
<b>BAB I.....</b>	<b>1</b>
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian .....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian .....	3
1.3 Perumusan Masalah .....	11
1.4 Pertanyaan Penelitian .....	12
1.5 Tujuan Penelitian .....	12
1.6 Manfaat Penelitian .....	13
1.6.1 Aspek Teoritis.....	13
1.6.2 Aspek Praktis.....	13
1.7 Ruang Lingkup Penelitian .....	14
1.7.1 Variabel Penelitian .....	14
1.7.2 Lokasi dan Objek Penelitian .....	14
1.7.3 Waktu dan Periode Penelitian.....	14
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	15
<b>BAB II .....</b>	<b>17</b>
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian .....	17
2.1.1 <i>Return Saham</i> .....	17
2.1.2 <i>Profitabilitas</i> .....	18
2.1.3 <i>Leverage</i> .....	19

2.1.4	Ukuran Perusahaan.....	20
2.2	Penelitian Terdahulu .....	21
2.3	Kerangka Pemikiran.....	36
2.3.1	Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> .....	36
2.3.2	Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	37
2.3.3	Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> .....	38
2.4	Hipotesis Penelitian .....	39
<b>BAB III</b>	.....	<b>41</b>
3.1	Karakteristik Penelitian .....	41
3.2	Variabel Operasional .....	42
3.1.1	Variabel Dependen (Y).....	42
3.1.2	Variabel Independen (X) .....	43
3.3	Tahapan Penelitian .....	46
3.4	Populasi dan Sampel .....	49
3.4.1	Populasi .....	49
3.4.2	Sampel .....	49
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	51
3.6	Teknik Analisis Data.....	52
3.6.1	Statistik Deskriptif.....	52
3.6.2	Uji Regresi Data Panel .....	52
3.6.3	Pemilihan Metode Estimasi Regresi Data Panel.....	53
3.6.4	Pengujian Hipotesis .....	55
<b>BAB IV</b>	.....	<b>59</b>
4.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	59
4.1.1	Profitabilitas (ROA) .....	60
4.1.2	<i>Leverage</i> (DER).....	62
4.1.3	Ukuran Perusahaan.....	63
4.1.4	<i>Return Saham</i> .....	65
4.2	Pengujian Pemilihan Model .....	66
4.2.1	Uji Signifikansi <i>Common Effect</i> atau <i>Fixed Effect</i> ( <i>Chow Test</i> ).....	67
4.2.2	Uji Signifikansi <i>Fixed Effect</i> atau <i>Random Effect</i> ( <i>Chow Hausman</i> ) ..	68
4.3	Persamaan Regresi Data Panel .....	69
4.4	Pengujian Hipotesis.....	71
4.4.1	Hasil Pengujian Hipotesis Secara Simultan (Uji F).....	71

4.4.2 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	72
4.4.3 Hasil Pengujian Hipotesis Secara Parsial (Uji T) .....	72
4.5 Pembahasan Hasil Penelitian .....	73
4.5.1 Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> .....	73
4.5.2 Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	74
4.5.3 Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> .....	75
<b>BAB V</b> .....	<b>77</b>
5.1 Kesimpulan .....	77
5.2 Saran .....	78
5.2.1 Aspek Teoritis .....	78
5.2.2 Aspek Praktis .....	79
<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	<b>81</b>
<b>LAMPIRAN</b>	