

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING SKRIPSI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
SURAT PERNYATAAN MENGENAI ORIGINALITAS SKRIPSI, KESEDIAAN PUBLIKASI DAN PELIMPAHAN HAK CIPTA	iii
PRAKATA	iv
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	9
1.3. Tujuan Penelitian.....	10
1.4. Manfaat Penelitian.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1. <i>Grand Theory</i>	13
2.1.1. Teori <i>Stakeholder (Stakeholder Theory)</i>	13
2.1.2. Teori Sinyal (<i>Signal Theory</i>)	14
2.2. Variabel Independen.....	15
2.2.1. Risiko Saham.....	15
2.2.2. Profitabilitas	17
2.2.3. Kebijakan Dividen.....	21
2.3.2. Jenis-jenis <i>Return Saham</i>	24
2.3.3. Sumber-sumber <i>Return Saham</i>	25
2.4. Variabel Kontrol.....	25
2.4.1. Ukuran Perusahaan	25
2.5. Penelitian Terdahulu	27
2.6. Perbedaan dengan Penelitian Sebelumnya.....	33
2.7. Kerangka Pemikiran	34

2.8.	Pengembangan Hipotesis	35
2.8.1.	Pengaruh Risiko Saham terhadap <i>Return</i> Saham	35
2.8.2.	Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return</i> Saham	35
2.8.3.	Pengaruh Kebijakan Dividen Terhadap <i>Return</i> Saham	36
2.8.4.	Pengaruh Risiko Saham, Profitabilitas, dan Kebijakan Dividen Terhadap <i>Return</i> Saham	36
BAB III METODE PENELITIAN		39
3.1.	Jenis Penelitian	39
3.2.	Objek Penelitian	39
3.3.	Populasi dan Sampel	39
3.4.	Teknik Pengumpulan Data	42
3.5.	Variabel Penelitian	42
3.6.	Operasional Variabel	43
3.7.	Teknik Analisis Data	45
3.7.1.	Estimasi Model Regresi	45
3.7.2.	Pemilihan Model Regresi	46
3.7.3.	Statistik Deskriptif	46
3.7.4.	Uji Asumsi Klasik	47
3.7.5.	Uji Signifikan Simultan (Uji F)	49
3.7.6.	Uji Signifikan Parameter Individual (Uji t)	49
3.7.7.	Koefisien Determinasi (R^2)	49
3.7.8.	Analisis Regresi Data Panel	50
BAB IV HASIL DAN ANALISIS PENELITIAN		51
4.1	Deskripsi Data Penelitian	51
4.2	Analisis Statistik Deskriptif	52
4.3	Pemilihan Model Regresi	56
4.4	Uji Asumsi Klasik	57
4.4.1.	Uji Normalitas	57
4.4.2.	Uji Multikolinearitas	58
4.4.3.	Uji Heteroskedastisitas	59
4.4.4.	Uji Autokorelasi	60
4.5	Uji Hipotesis	61
4.5.1.	Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	61
4.5.2.	Uji Signifikansi Parsial (Uji t)	61
4.5.3.	Uji Koefisien Determinasi R^2	62

4.5.4. Analisis Regresi Data Panel.....	63
4.6 Pembahasan Hasil Penelitian.....	65
4.6.1. Pengaruh Risiko Saham terhadap <i>Return Saham</i> (H1)	65
4.6.2. Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return Saham</i> (H2)	66
4.6.3. Pengaruh Kebijakan Dividen terhadap <i>Return Saham</i> (H3).....	67
4.6.4 Pengaruh Risiko Saham, Profitabilitas, dan Kebijakan Dividen secara simultan terhadap <i>Return Saham</i>	69
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	71
5.1 Kesimpulan	71
5.2 Keterbatasan Penelitian	72
5.3 Saran	72
DAFTAR PUSTAKA	73
LAMPIRAN	81

