

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING SKRIPSI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI.....	ii
SURAT PERNYATAAN MENGENAI ORIGINALITAS SKRIPSI, KESEDIAAN PUBLIKASI DAN PELIMPAHAN HAK CIPTA	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRACT.....	vi
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
2.1 Grand Theory.....	11
2.1.1 Teori Agensi (<i>Agency Theory</i>).....	11
2.1.2 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	13
2.1.3 Profitabilitas	15
2.1.4 Ukuran Perusahaan.....	16
2.1.5 Pertumbuhan Penjualan.....	18
2.1.6 <i>Return</i> Saham.....	19
2.2 Penelitian Terdahulu.....	20
2.3 Perbedaan Dengan Penelitian Saat Ini	23
2.4 Kerangka Pemikiran	24
2.5 Pengembangan Hipotesis.....	24
2.5.1 Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return</i> Saham.....	24
2.5.2 Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return</i> Saham.....	25
2.5.3 Pengaruh Pertumbuhan Penjualan Terhadap <i>Return</i> Saham..	26

2.5.4 Pengaruh Profitabilitas, Ukuran Perusahaan dan Pertumbuhan Penjualan Terhadap <i>Return Saham</i>	27
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	31
3.1 Jenis Penelitian	31
3.2 Objek Penelitian.....	31
3.3 Populasi dan Sampel.....	32
3.3.1 Populasi	32
3.3.2 Sampel.....	32
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	34
3.5 Variabel Penelitian.....	34
3.5.1 Variabel Independen.....	34
3.5.1.1 Profitabilitas.....	35
3.5.1.2 Ukuran Perusahaan	35
3.5.1.3 Pertumbuhan Penjualan	36
3.5.2 Variabel Dependen	36
3.5.2.1 Return Saham	37
3.6 Operasionalisasi Variabel	38
3.7 Analisis Data.....	41
3.7.1 Estimasi Model Regresi Data Panel	41
3.7.1.1 Common Effect Model (CEM).....	42
3.7.1.2 Fix Effect Model (FEM).....	42
3.7.1.3 Random Effect Model (REM).....	42
3.7.2 Teknik Pemilihan Model Regresi Data Panel	43
3.7.2.1 Uji Chow.....	43
3.7.2.2 Uji Hausman	43
3.7.2.3 Uji Lagrange Multiplier	43
3.7.3 Analisis Statistik Deskriptif.....	44
3.7.4 Uji Asumsi Klasik	44
3.7.4.1 Uji Multikolinieritas	44
3.7.4.2 Uji Heteroskedastisitas	45
3.7.5 Uji Hipotesis.....	45
3.7.5.1 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	45

3.7.5.2 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	46
3.7.5.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t)	47
3.7.6 Analisis Regresi Data Panel	47
BAB IV HASIL DAN ANALISIS PENELITIAN	49
4.1 Deskripsi Data Penelitian.....	49
4.2 Uji Analisis Data.....	50
4.2.1 Estimasi Model Regresi Data Panel	50
4.2.1.1 Common Effect Model (CEM).....	50
4.2.1.2 Fixed Effect Model (FEM)	51
4.2.1.3 Random Effect Model (REM)	51
4.2.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	52
4.2.2.1 Uji Chow.....	52
4.2.2.2 Uji Hausman	53
4.2.2.3 Uji Lagrange Multiplier.....	53
4.2.2.4 Kesimpulan Model	54
4.2.3 Analisis Statistik Deskriptif.....	54
4.2.4 Uji Asumsi Klasik	57
4.2.4.1 Uji Multikolinieritas	57
4.2.4.2 Uji Heteroskedastisitas	57
4.2.5 Uji Hipotesis.....	58
4.2.5.1 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	58
4.2.5.2 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	60
4.2.5.3 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t)	61
4.2.6 Analisis Persamaan Model Regresi Data Panel	63
4.2.7 Pembahasan Hasil Penelitian.....	64
BAB V PENUTUP.....	71
5.1 Kesimpulan	71
5.2 Keterbatasan.....	71
5.3 Saran	72
DAFTAR PUSTAKA	75
LAMPIRAN.....	78