

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN	Error! Bookmark not defined.
LEMBAR ORISINALITAS	Error! Bookmark not defined.
SURAT PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI	Error! Bookmark not defined.
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Pertanyaan Penelitian.....	10
C. Tujuan Penelitian.....	10
D. Kebaruan Penelitian.....	11
E. Manfaat Penelitian.....	11
BAB II	13
KAJIAN PUSTAKA	13
A. Latar Belakang Teori.....	13
B. Hasil Penelitian Relevan.....	18
C. Kerangka Pemikiran.....	27
a. Kerangka Teoritik.....	27
b. Hipotesis.....	34
BAB III	35
METODE PENELITIAN	35
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	35
B. Metode Penelitian.....	35
C. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	36

D. Metode Pengumpulan Data.....	40
E. Populasi dan Sampling.....	41
F. Metode Analisis Data.....	42
BAB IV	47
PEMBAHASAN	47
A. Hasil Statistik Deskriptif.....	47
B. Hasil Uji Asumsi Klasik.....	53
C. Hasil Uji Regresi Data Panel.....	54
1. Uji Chow.....	54
2. Uji Hausman.....	57
3. Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	58
D. Hasil Uji Regresi dan Pembahasan.....	60
E. Hasil Uji Hipotesis.....	63
F. Koefisiensi Determinasi (R^2).....	70
BAB V	72
KESIMPULAN DAN SARAN	72
A. Kesimpulan.....	72
B. Implikasi.....	73
C. Saran.....	74
DAFTAR PUSTAKA	75
LAMPIRAN	78

DAFTAR GAMBAR

Gambar II. 1 Kerangka Pemikiran	34
Gambar IV. 1 Rata-Rata Variabel per Tahun	48



DAFTAR TABEL

Tabel IV. 1 Statistik Deskriptif.....	47
Tabel IV. 2 Uji Multikolinearitas	53
Tabel IV. 3 Uji Chow <i>Return Saham</i>	55
Tabel IV. 4 Uji Chow <i>Tobin's Q</i>	56
Tabel IV. 5 Uji Hausman <i>Return Saham</i>	57
Tabel IV. 6 Uji Hausman <i>Tobin's Q</i>	58
Tabel IV. 7 Uji Lagrange Multiplier <i>Return Saham</i>	59
Tabel IV. 8 Regresi per Variabel.....	60
Tabel IV. 9 Uji T per Variabel.....	64
Tabel IV. 10 Koefisiensi Determinasi	70



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Nama Perusahaan.....	79
Lampiran 2 Data Sampel Variabel.....	81
Lampiran 3 Statistic Descriptive.....	87
Lampiran 4 Uji Correlation.....	88
Lampiran 5 Uji Chow – <i>Return Saham</i>	89
Lampiran 6 Uji Chow – <i>Tobin's Q</i>	90
Lampiran 7 Uji Hausman – <i>Return Saham</i>	91
Lampiran 8 Uji Hausman – <i>Tobin's Q</i>	92
Lampiran 9 Uji Lagrange Multiplier – <i>Return Saham</i>	93
Lampiran 10 Uji Uji Common Effect – <i>Return Saham</i>	94
Lampiran 11 Uji <i>Fixed Effect</i> – <i>Tobin's Q</i>	95

