

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN.....	v
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	12
C. Tujuan Penelitian	13
D. Manfaat Penelitian.....	14
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, HIPOTESIS	16
A. Kajian Pustaka.....	16
1. <i>Signalling Theory</i>	16
2. Pasar Modal.....	17
3. Saham.....	21
4. Laporan Keuangan.....	24
5. Laporan Tahunan.....	26
6. Struktur Modal	27
7. <i>Trade-off Theory</i>	27
8. Teori Modigliani-Miller Tanpa Pajak.....	28
9. Teori Modigliani-Miller Dengan Pajak	28

10. <i>Return Saham</i>	29
a. Teori <i>Return Saham</i>	29
b. Jenis-Jenis <i>Return Saham</i>	31
c. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	32
11. <i>Economic Value Added</i>	34
12. <i>Operating Cash Flow</i>	37
13. <i>Leverage</i>	39
14. <i>Dividend Yield</i>	40
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	41
C. Kerangka Teoritik	50
D. Hipotesis	53
BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN	55
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	55
B. Metodologi Penelitian	55
C. Operasionalisasi Variabel Penelitian	56
1. Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>)	56
2. Variabel Bebas (<i>Independent Variable</i>)	58
D. Metode Pengumpulan Data	63
E. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	64
F. Metode Analisis	66
1. Statistik Deskriptif.....	66
2. Uji Multikolinearitas.....	66
3. Analisis Model Regresi Data Panel	67
4. Pengujian Hipotesis	73
5. Koefisien Determinasi	73
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	75
A. Statistik Deskriptif.....	75

B. Hasil Uji Regresi Data Panel.....	80
1. <i>Chow Test</i>	80
2. <i>Langrangge Multiplier Test</i>	82
C. Uji Multikolinearitas.....	83
D. Hasil Uji Regresi dan Pembahasan.....	85
E. Hasil Uji Hipotesis.....	87
F. Koefisien Determinasi.....	93
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	94
A. Kesimpulan.....	94
B. Implikasi.....	98
C. Saran.....	99
DAFTAR PUSTAKA	101
LAMPIRAN	107
RIWAYAT HIDUP	116