

DAFTAR ISI

JUDUL

LEMBAR PENGESAHAN	i
SURAT PERNYATAAN.....	ii
ABSTRAK.....	iii
ABSTRACT	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1	Latar Belakang Masalah	1
1.2	Identifikasi Masalah	16
1.3	Tujuan Penelitian.....	17
1.4	Kegunaan Penelitian	18

BAB II LANDASAN TEORI, KERANGKA

PEMIKIRAN

2.1	Landasan Teori	19
2.1.1	Grand Teori	19
2.1.2	Konsep Kinerja Keuangan.....	22
2.1.2.1	Rasio Likuiditas	25
2.1.2.2	Rasio Aktivitas.....	28

2.1.2.3	Rasio Solvabilitas	30
2.1.2.4	Rasio Profitabilitas.....	32
2.1.2.5	Economic Value Added (EVA)	33
2.1.3	Return Saham	38
2.1.4	Penelitian Terdahulu.....	42
2.2	Kerangka Pemikiran	47
2.2.1	Pengaruh Current Ratio(CR) terhadap Return Saham	47
2.2.2	Pengaruh Total Asset Turnover (TATO) terhadap Return Saham.....	48
2.2.3	Pengaruh Debt To Equity Ratio (DER) terhadap Return Saham.....	49
2.2.4	Pengaruh Return On Asset (ROA) terhadap Return Saham.....	50
2.2.5	Pengaruh Economic Value Added (EVA) terhadap Return Saham.....	51
2.2.6	Pengaruh Kinerja Keuangan terhadap Return Saham	52
2.3	Hipotesis	57

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian.....	59
3.2	Metode Penelitian	60
3.2.1	Unit Analisis	60
3.2.2	Populasi dan Sample.....	61

3.2.3	Teknik Pengumpulan Sample	62
3.2.4	Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	62
3.2.5	Teknik Pengumpulan Data	63
3.2.6	Operasional Variabel	65
3.3	Metode Analisis Data	67
3.3.1	Statistik Deskriptif.....	67
3.3.2	Analisis Regresi Data Panel.....	67
3.3.2.1	Model Common Effect.....	70
3.3.2.2	Model Fixed Effect	70
3.3.2.3	Model Random Effect	71
3.4	Uji Asumsi Klasik.....	75
3.4.1	Uji Normalitas	75
3.4.2	Uji Multikolinearitas	76
3.4.3	Uji Heteroskedastisitas	77
3.4.4	Uji Autokorelasi	78
3.5	Pengujian Hipotesis	79
3.5.1	Uji t atau Uji Parsial	79
3.5.2	Uji F atau Uji Simultan.....	80
3.5.3	Koefisien Determinasi	81

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Hasil Penelitian.....	82
4.1.1	Lingkungan Makro Perusahaan Manufaktur Sektor Barang Konsumsi	82
4.1.2	Uji Deskriptif.....	83
4.1.3	Penentuan Metode Estimasi Data Panel	89

1.	Uji Chow	90
2.	Uji Hausman.....	92
3.	Uji Lagrange Multiplier.....	93
4.1.4	Uji Asumsi Klasik	94
4.1.4.1	Uji Normalitas.....	94
4.1.4.2	Uji Multikolinearitas	96
4.1.4.3	Uji Heteroskedastisitas.....	97
4.1.4.4	Uji Autokorelasi	99
4.1.5	Estimasi Model regresi	101
4.1.6	Koefisien Determinasi (R^2).....	104
4.1.7	Uji Hipotesis.....	104
4.1.7.1.	Uji Parsial (t)	104
4.1.7.2.	Uji Model (F)	109
4.2	Pembahasan	110
4.2.1	Pengaruh Current Ratio (CR) terhadap Return Saham	110
4.2.2	Pengaruh Total Asset Turnover (TATO) Dengan Return Saham.....	112
4.2.3	Pengaruh Debt to Equity Ratio (DER) Terhadap Return Saham	113
4.2.4	Pengaruh Return On Assets (ROA) Dengan Return Saham.....	115
4.2.5	Pengaruh Economic Value Added (EVA) Dengan Return Saham	116
4.2.6	Pengaruh Current Ratio (CR), Total Asset Turnover (TATO), Debt to	

	Equity Ratio (DER) Return On Asset (ROA) dan Economic Value Added (EVA) terhadap Return saham.....	118
4.3	Implikasi Manajerial.....	122

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1	Simpulan.....	127
5.2	Saran	129

DAFTAR PUSTAKA

Daftar Pustaka	132
----------------------	-----

LAMPIRAN

Daftar Lampiran	xv
-----------------------	----