

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
BERITA ACARA UJIAN SKRIPSI.....	iii
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
SYARAT PERNYATAAN KEBENARAN NILAI	v
KATA PENGANTAR.....	vii
MOTTO	viii
ABSTRAK	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
DAFTAR GAMBAR.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	13
1.3 Tujuan Penelitian	13

1.4 Batasan Penelitian	13
1.5 Manfaat Penelitian	14
1.6 Sistematika Pembahasan	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	16
2.1 Tinjauan Teori.....	16
2.1.1 Pasar Modal	16
2.1.1.1 Instrumen Pasar Modal.....	16
2.1.1.2 Fungsi Pasar Modal	18
2.1.1.3 Jenis-jenis Pasar Modal	19
2.1.2 Laporan Keuangan	20
2.1.3 <i>Return Saham</i>	21
2.1.3.1 Jenis <i>Return Saham</i>	22
2.1.3.2 Komponen <i>Return Saham</i>	22
2.1.4 <i>Return On Equity</i>	23
2.1.5 <i>Debt to Equity Rattio</i>	23
2.1.6 <i>Earning Per Share</i>	23
2.1.7 Teori Keagenan (<i>Agency Theory</i>).....	23
2.1.8 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	24
2.1.9 <i>Good Corporate Governance</i>	24
2.1.9.1 Prinsip-prinsip GCG.....	25
2.1.9.2 Manfaat GCG.....	26
2.1.9.3 Organ Khusus dalam Penerapan GCG.....	27
2.1.10 <i>Corporate Social Responsibility</i>	29

2.1.10.1	Pengungkapan <i>Corporate Social Responsibility</i>	30
2.1.10.2	Pedoman Laporan Keberlanjutan GRI	31
2.2	Tinjauan Penelitian Terdahulu	33
2.3	Kerangka Konseptual	36
2.4	Hipotesis.....	37
2.4.1	<i>Return On Equity (ROE)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	37
2.4.2	<i>Debt to Equity Ratio (DER)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	37
2.4.3	<i>Earning Per Share (EPS)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	38
2.4.4	<i>Good Corporate Governance (GCG)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	39
2.4.5	<i>Corporate Social Responsibility (CSR)</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	40
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		42
3.1	Rancangan Penelitian.....	42
3.2	Populasi dan Sampel	42
3.3	Data dan Sumber Data	43
3.4	Identifikasi Variabel dan Pengukurannya	43
3.4.1	Variabel Bebas	44
3.4.1.1	<i>Return On Equity (ROE)</i>	44
3.4.1.2	<i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	45
3.4.1.3	<i>Earning Per Share (EPS)</i>	45
3.4.1.4	<i>Good Corporate Governance (GCG)</i>	46
3.4.1.5	<i>Corporate Social Responsibility (CSR)</i>	46
3.4.2	Variabel Terikat	47
3.5	Metode Analisis Data.....	48

3.5.1 Statistik Deskriptif	48
3.5.2 Regresi Linear Berganda.....	48
3.5.3 Uji Asumsi Klasik.....	49
3.5.3.1 Uji Normalitas.....	50
3.5.3.2 Uji Multikolinearitas	50
3.5.3.3 Uji Autokorelasi.....	51
3.5.3.4 Uji Heterokedastisitas	52
3.5.4 Pengujian Hipotesis	53
3.5.4.1 Uji Koefisien Determinasi	53
3.5.4.2 Uji Statistik F.....	54
3.5.4.3 Uji Statistik T.....	54
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	55
4.1 Analisis Deskriptif	56
4.2 Hasil Analisis Regresi Linear Berganda	57
4.3 Pengujian Asumsi Klasik	60
4.3.1 Uji Normalitas.....	60
4.3.2 Uji Multikolinearitas	60
4.3.3 Uji Autokorelasi.....	61
4.3.4 Uji Heterokedastisitas	63
4.4 Pengujian Hipotesis.....	64
4.5 Pembahasan	67
4.5.1 Pengaruh ROE Terhadap <i>Return Saham</i>	67
4.5.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	68

4.5.3 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	70
4.5.4 Pengaruh <i>Good Corporate Governance</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	71
4.5.5 Pengaruh <i>Corporate Social Responsibility</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	72
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	74
5.1 Kesimpulan	74
5.2 Keterbatasan	76
5.3 Saran	77
DAFTAR PUSTAKA	79

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	33
Tabel 3.1 Pengambilan Keputusan Uji Autokorelasi	52
Tabel 4.1 Penarikan Sampel.....	55
Tabel 4.2 Hasil Uji Analisis Deskriptif.....	56
Tabel 4.3 Hasil Regresi Linear	58
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas	60
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas	61
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi	62
Tabel 4.7 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	63
Tabel 4.8 Hasil Uji Koefisien Determinasi	64
Tabel 4.9 Hasil Uji F.....	64
Tabel 4.10 Hasil Uji T.....	65

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1	84
Lampiran 2	85
Lampiran 3	85
Lampiran 4	87
Lampiran 5	88
Lampiran 6	89
Lampiran 7	111

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Kerangka Konseptual	36