

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR PENGESAHAN.....	i
MOTTO	ii
PERNYATAAN	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah	25
1.3 Tujuan Penelitian.....	26
1.4 Kegunaan Hasil Penelitian.....	26
1.5 Lokasi dan Jadwal Penelitian.....	27
1.5.1 Lokasi Penelitian	27
1.5.2 Waktu Penelitian	27
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS.....	28
2.1 Tinjauan Pustaka	28
2.1.1 Profitabilitas	28
2.1.1.1 Pengertian Profitabilitas.....	28
2.1.1.2 Tujuan dan Manfaat Rasio Profitabilitas	29
2.1.1.3 Jenis-jenis Rasio Profitabilitas	30
2.1.2 <i>Leverage</i>	34
2.1.2.1 Pengertian <i>Leverage</i>	34
2.1.2.2 Tujuan dan Manfaat Rasio <i>Leverage</i>	35
2.1.2.3 Jenis-jenis Rasio <i>Leverage</i>	37

2.1.3 Likuiditas	41
2.1.3.1 Pengertian Likuiditas	41
2.1.3.2 Tujuan dan Manfaat Rasio Likuiditas.....	42
2.1.3.3 Jenis-jenis Rasio Likuiditas.....	43
2.1.4 Ukuran Perusahaan	46
2.1.4.1 Pengertian Ukuran Perusahaan.....	46
2.1.4.2 Pengukuran Ukuran Perusahaan.....	47
2.1.5 Return Saham	52
2.1.5.1 Pengertian <i>Return</i> Saham.....	52
2.1.5.2 Jenis-jenis <i>Return</i> Saham	53
2.1.5.3 Faktor-faktor yang Memengaruhi <i>Return</i> Saham.....	53
2.1.5.4 Komponen <i>Return</i> Saham	55
2.1.5.5 Pengukuran <i>Return</i> Saham.....	55
2.2 Kerangka Pemikiran	56
2.3 Hipotesis	62
BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN.....	63
3.1 Objek Penelitian	63
3.1.1 Sejarah Bursa Efek Indonesia	63
3.1.2 Indeks LQ45.....	66
3.2 Metode Penelitian.....	68
3.2.1 Operasionalisasi Variabel	69
3.2.2 Teknik Pengumpulan Data.....	71
3.2.2.1 Jenis Data	71
3.2.2.2 Populasi Sasaran.....	72
3.2.2.3 Penentuan Sampel.....	73
3.3 Model/Paradigma Penelitian.....	75
3.4 Teknik Analisis Data	76
3.4.1 Uji Asumsi Klasik	76
3.4.1.1 Uji Normalitas	76
3.4.1.2 Uji Multikolinearitas.....	77
3.4.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	77

3.4.1.4 Uji Autokolerasi	78
3.4.2 Analisis Regresi Data Panel	78
3.4.2.1 Metode Estimasi Regresi Data Panel.....	79
3.4.2.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel	82
3.4.3 Koefisien Determinasi (R^2)	83
3.4.4 Uji Hipotesis.....	84
3.4.4.1 Uji Secara Bersama-sama (Uji F).....	84
3.4.4.2 Uji Secara Parsial (Uji-t).....	85
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	87
4.1 Hasil Penelitian	87
4.1.1 Profitabilitas pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	87
4.1.2 <i>Leverage</i> pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	89
4.1.3 Likuiditas pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	90
4.1.4 Ukuran Perusahaan pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	91
4.1.5 <i>Return Saham</i> pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	93
4.1.6 Hasil Analisis	94
4.1.6.1 Uji Asumsi Klasik	94
4.1.6.1.1 Uji Normalitas	94
4.1.6.1.2 Uji Multikolinearitas	95
4.1.6.1.3 Uji Heteroskedastisitas	96
4.1.6.1.4 Uji Autokolerasi	96
4.1.6.2 Analisis Regresi Data Panel	97
4.1.6.2.1 Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	97
4.1.6.2.2 Hasil Regresi Data Panel	101
4.1.6.3 Koefisien Determinasi (R^2)	103
4.1.6.4 Pengujian Hipotesis	103

4.1.6.4.1 Uji Signifikansi Secara Bersama-sama (Uji F)	103
4.1.6.4.2 Uji Signifikansi Parsial (Uji T)	105
4.2 Pembahasan.....	108
4.2.1 Profitabilitas, <i>Leverage</i> , Likuiditas, Ukuran Perusahaan, dan <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	108
4.2.1.1 Profitabilitas pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	108
4.2.1.2 <i>Leverage</i> pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	112
4.2.1.3 Likuiditas pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	116
4.2.1.4 Ukuran Perusahaan pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	120
4.2.1.5 <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	123
4.2.2 Pengaruh Profitabilitas, <i>Leverage</i> , Likuiditas, dan Ukuran Perusahaan Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	126
4.2.2.1 Pengaruh Profitabilitas, <i>Leverage</i> , Likuiditas, dan Ukuran Perusahaan Secara Bersama-sama Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	126
4.2.2.2 Pengaruh Profitabilitas Secara Parsial Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	128
4.2.2.3 Pengaruh <i>Leverage</i> Secara Parsial Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	129
4.2.2.4 Pengaruh Likuiditas Secara Parsial Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019	131
4.2.2.5 Pengaruh Ukuran Perusahaan Secara Parsial Terhadap <i>Return</i> Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019.....	132

BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	134
5.1 Simpulan.....	134
5.2 Saran.....	135
DAFTAR PUSTAKA.....	137
LAMPIRAN.....	143