

DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

PERNYATAAN

ABSTRACT i

ABSTRAK ii

KATA PENGANTAR..... iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR TABEL viii

DAFTAR GAMBAR..... ix

DAFTAR LAMPIRAN x

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang..... 1

1.2 Identifikasi Masalah..... 17

1.3 Tujuan Penelitian 17

1.4 Kegunaan Penelitian 18

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian..... 19

BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Tinjauan Pustaka..... 20

2.1.1 *Firm Size* 20

2.1.1.1	Pengertian <i>Firm Size</i>	20
2.1.1.2	Jenis-jenis Perusahaan.....	21
2.1.1.3	Kategori Perusahaan.....	22
2.1.1.4	Pengukuran <i>Firm Size</i>	23
2.1.2	<i>Price Earning Ratio</i> (PER)	24
2.1.2.1	Pengertian <i>Price Earning Ratio</i> (PER)	24
2.1.2.2	Kegunaan dan Manfaat <i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	26
2.1.3	<i>Return Saham</i>	27
2.1.3.1	Pengertian <i>Return Saham</i>	27
2.1.3.2	Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	28
2.1.3.3	Jenis-jenis <i>Return Saham</i>	30
2.1.3.4	Komponen <i>Return Saham</i>	31
2.1.3.5	Rumus <i>Return Saham</i>	33
2.2	Kerangka Pemikiran.....	34
2.3	Hipotesis.....	40

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian.....	41
3.1.1	Sejarah Bursa Efek Indonesia	41
3.1.2	Gambaran Umum Perusahaan.....	43
3.2	Metode Penelitian	56
3.2.1	Operasionalisasi Variabel	56
3.2.2	Teknik Pengumpulan Data.....	58

3.2.2.1 Jenis Data.....	58
3.2.2.2 Populasi Sasaran.....	59
3.2.2.3 Sampel Penelitian.....	60
3.2.2.4 Prosedur Pengumpulan Data.....	61
3.3 Paradigma Penelitian	62
3.4 Teknik Analisis Data	63
3.4.1 Teknik Estimasi Regresi Data Panel	63
3.4.2 Pemilihan Model	64
3.4.3 Uji Asumsi Klasik	65
3.4.3.1 Uji Normalitas.....	65
3.4.3.2 Uji Multikolinearitas	65
3.4.3.3 Uji Heteroskedastisitas	66
3.4.3.4 Uji Autokolerasi.....	66
3.4.3.5 Regresi Data Panel	67
3.4.4 Pengujian Hipotesis	69

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian.....	70
4.1.1 <i>Firm Size</i> pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018	72
4.1.2 <i>Price Earning Ratio</i> (PER) pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018	73
4.1.3 <i>Return Saham</i> pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek	

Indonesia Periode 2015-2018.....	74
4.1.4 Uji Kelayakan Data	75
4.1.4.1 Pemilihan Model.....	75
4.1.4.2 Uji Asumsi Klasik	77
4.2 Pembahasan	79
4.2.1 <i>Firm Size</i> , <i>Price Earning Ratio</i> dan <i>Return Saham Size</i> pada Indonesia Periode 2015-2018.....	79
4.2.1.1 <i>Firm Size</i> pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018.....	79
4.2.1.2 <i>Price Earning Ratio</i> (PER) pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018.....	81
4.2.1.3 <i>Return Saham</i> pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018.....	83
4.2.2 Hasil Pengujian Secara Parsial.....	84
4.2.2.1 Pengaruh <i>Firm Size</i> Terhadap Return Saham pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia 2015-2018	85
4.2.2.2 Pengaruh PER Terhadap Return Saham pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia 2015-2018.....	86
4.2.3 Hasil Pengujian Secara Simultan	87
4.2.3.1 Pengaruh <i>Firm Size</i> dan <i>Price Earning Ratio</i> Secara Simultan Terhadap <i>Return Saham</i> pada Perusahaan Makanan dan	

Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018.....	87
--	----

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan.....	89
-------------------	----

5.2 Saran.....	91
----------------	----

DAFTAR PUSTAKA	93
----------------------	----