

DAFTAR ISI

	Halaman
<i>ABSTRACT</i>	i
ABSTRAK	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
BAB I : PENDAHULUAN	
1.1 Latar belakang Penelitian.....	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	23
1.3 Tujuan Penelitian	24
1.4 Kegunaan Hasil Penelitian.....	24
1.5 Lokasi dan Jadwal Penelitian.....	25
1.5.1 Lokasi Penelitian.....	25
1.5.2 Jadwal Penelitian.....	25
BAB II : TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	
2.1 Tinjauan Pustaka.....	26
2.1.1 <i>Leverage</i>	26
2.1.1.1 Tujuan dan Manfaat <i>Leverage</i>	28
2.1.1.2 Jenis-Jenis <i>Leverage</i>	29
2.1.1.3 Pengukuran <i>Leverage</i>	32

2.1.2	<i>Profit Margin</i>	35
2.1.2.1	Pengukuran <i>Profit Margin</i>	30
2.1.3	<i>Firm Size</i>	37
2.1.3.1	Klasifikasi <i>Firm Size</i>	38
2.1.3.2	Pengukuran <i>Firm Size</i>	40
2.1.4	<i>Stock Return</i>	41
2.1.4.1	Jenis-jenis <i>Stock Return</i>	42
2.1.4.2	Pengukuran <i>Stock Return</i>	43
2.1.4.3	Saham	43
2.1.4.3.1	Jenis-jenis Saham	44
2.1.4.3.2	Harga Saham	45
2.1.4.3.3	Faktor-faktor yang Mempengaruhi Saham	46
2.2	Kerangka Pemikiran	46
2.3	Hipotesis	50

BAB III : OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian	51
3.2	Metode Penelitian	51
3.2.1	Operasionalisasi Variabel	52
3.2.2	Teknik Pengumpulan Data	54
3.2.2.1	Jenis Data	54
3.2.2.2	Populasi dan Sasaran	54
3.2.2.3	Penentuan Sampel	59

3.2.2.4	Prosedur Pengumpulan Data.....	60
3.3	Model Penelitian	63
3.4	Teknik Analisis Data.....	64
3.4.1	Analisis Data	64
3.4.2	Uji Asumsi Klasik.....	65
3.4.3	Analisis Regresi Linear Panel Data.....	67
3.4.3.1	Pengujian Hipotesis	73
3.4.3.2	Koefisien Determinasi	77
3.5	Desain Penelitian Lengkap	78
 BAB IV: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		
4.1.	Hasil Penelitian	79
4.1.1	<i>Leverage</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	79
4.1.2.	<i>Profit Margin</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI ...	81
4.1.3.	<i>Firm Size</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	84
4.1.4.	<i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI....	86
4.2.	Pembahasan.....	91
4.2.1.	<i>Leverage, Profit Margin, Firm Size</i> dan <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI	91
4.2.1.1	<i>Leverage</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	91
4.2.1.2	<i>Profit Margin</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	93
4.2.1.3	<i>Firm Size</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	95
4.2.1.4	<i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar Bursa Efek Indonesia	97

4.2.2. Pengaruh <i>Leverage</i> , <i>Profit Margin</i> dan <i>Firm Size</i> terhadap <i>Stock Return Saham</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI	98
4.2.2.1 Pengaruh Secara Parsial <i>Leverage</i> Terhadap <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	99
4.2.2.2 Pengaruh Secara Parsial <i>Profit Margin</i> Terhadap <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	101
4.2.2.3 Pengaruh Secara Parsial <i>Firm Size</i> Terhadap <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	102
4.2.2.4 Pengaruh Secara Simultan <i>Leverage</i> , <i>Profit Margin</i> , dan <i>Firm Size</i> terhadap <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI	103
BAB V: SIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Simpulan.....	105
5.2. Saran	106
DAFTAR PUSTAKA.....	108
LAMPIRAN	112

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Persamaan dan Perbedaan Penelitian Terdahulu dengan Penelitian Penulis.....	17
Tabel 1.2 Jadwal Penelitian.....	26
Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel.....	53
Tabel 3.2 Daftar Sub Sektor Manufaktur yang terdaftar BEI	55
Tabel 3.3 Daftar Perusahaan Manufaktur yang terdaftar BEI	55
Tabel 3.4 Seleksi Menurut Syarat Penelitian	60
Tabel 4.1 Data <i>Debt to Equity Ratio</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	80
Tabel 4.2 Data <i>Profit Margin</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	82
Tabel 4.3 Data <i>Firm Size</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	84
Tabel 4.4 Data <i>Stock Return</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI.....	87
Tabel 4.5 Hasil <i>Output</i> EViews Uji Multikoleniaritas.....	90
Tabel 4.6 Hasil <i>Output</i> EViews Uji Heterokedastisitas.....	91
Tabel 4.7 Klasifikasi Perusahaan Berdasarkan Nilai DER.....	93
Tabel 4.8 Klasifikasi Perusahaan Berdasarkan Nilai NPM.....	95
Tabel 4.9 Hasil Analisis Regresi Linear Data Panel dengan Menggunakan <i>Common Effect Model</i>	98
Tabel 4.10 Hasil R-Square, Adjust R-Square dan Uji F.....	104

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1 Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan.....	7
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	49
Gambar 3.1 Model Penelitian	61
Gambar 3.2 Tahapan Regresi Linear Panel Data	67
Gambar 3.3 Desain Penelitian Lengkap.....	78
Gambar 4.1 Hasil Uji Asumsi Klasik Normalitas.....	80
Gambar 4.2 Hasil Uji Asumsi Klasik Autokolerasi.....	82
Gambar 4.3 Grafik Kondisi <i>Leverage</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2018.....	88
Gambar 4.4 Grafik Kondisi <i>Profit Margin</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2018.....	91
Gambar 4.5 Grafik Kondisi <i>Firm Size</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2018.....	
Gambar 4.6 Grafik Kondisi <i>Return Saham</i> Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2018.....	

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Jadwal Penelitian.....	112
Lampiran 2 Data Variabel yang akan diinput ke dalam EViews.....	113
Lampiran 3 Data Output Pengolahan EViews.....	121
Lampiran 4 Tabel Durbin Watson	130