

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
<b>PENGESAHAN</b> .....	<b>i</b>
<b>MOTO</b> .....	<b>ii</b>
<b>PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI</b> .....	<b>iii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>v</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xvi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Penelitian .....	1
1.2 Identifikasi Masalah .....	6
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Kegunaan Hasil Penelitian .....	8
1.4.1 Kegunaan Pengembangan Ilmu.....	8
1.4.2 Kegunaan Praktis .....	9
1.5 Lokasi dan Jadwal Penelitian .....	9
1.5.1 Lokasi Penelitian.....	9
1.5.2 Jadwal Penelitian.....	10
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS</b> .....	<b>11</b>
2.1 Tinjauan Pustaka .....	11

2.1.1	<i>Financial Distress</i> .....	11
2.1.1.1	Pengertian <i>Financial Distress</i> .....	11
2.1.1.2	Tahapan <i>Financial Distress</i> .....	12
2.1.1.3	Manfaat Prediksi <i>Financial Distress</i> .....	13
2.1.1.4	Pengukuran <i>Financial Distress</i> .....	14
2.1.2	<i>Mispricing</i> .....	16
2.1.2.1	Pengertian <i>Mispricing</i> .....	16
2.1.2.2	Pengukuran <i>Mispricing</i> .....	17
2.1.3	<i>Return Saham</i> .....	18
2.1.3.1	Pengertian <i>Return Saham</i> .....	18
2.1.3.2	Komponen <i>Return Saham</i> .....	19
2.1.3.3	Jenis-Jenis <i>Return Saham</i> .....	20
2.1.3.4	Pengukuran <i>Return Saham</i> .....	21
2.1.4	Penelitian Terdahulu .....	22
2.2	Kerangka Pemikiran.....	27
2.3	Hipotesis.....	30
<b>BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN .....</b>		<b>31</b>
3.1	Objek Penelitian .....	31
3.2	Metode Penelitian.....	31
3.2.1	Jenis Penelitian.....	31
3.2.2	Operasionalisasi Variabel.....	32
3.2.3	Teknik Pengumpulan Data.....	34
3.2.3.1	Jenis dan Sumber Data .....	34
3.2.3.2	Populasi Sasaran .....	34
3.2.3.3	Penentuan Sampel .....	35

3.2.4	Model Penelitian .....	38
3.2.5	Teknik Analisis Data.....	39
3.2.5.1	Statistik Deskriptif .....	39
3.2.5.2	Analisis Regresi Data Panel.....	40
3.2.5.3	Estimasi Model Regresi Data Panel.....	41
3.2.5.4	Pemilihan Estimasi Model Regresi Data Panel.....	42
3.2.5.5	Uji Asumsi Klasik.....	43
3.2.5.6	Pengujian Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	45
3.2.5.7	Pengujian Hipotesis.....	45
3.2.5.8	Uji Sobel .....	47
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>49</b>
4.1	Hasil Penelitian .....	49
4.1.1	Deskripsi Data Penelitian.....	49
4.1.1.1	<i>Financial Distress</i> pada Perusahaan Sektor Properti dan <i>Real Estate</i> yang Terdaftar di BEI.....	49
4.1.1.2	<i>Mispricing</i> pada Perusahaan Sektor Properti dan <i>Real Estate</i> yang Terdaftar di BEI.....	54
4.1.1.3	<i>Return Saham</i> pada Perusahaan Sektor Properti dan <i>Real Estate</i> yang Terdaftar di BEI.....	58
4.1.2	Pemilihan Estimasi Model Regresi Data Panel.....	62
4.1.3	Uji Asumsi Klasik.....	67
4.1.4	Hasil Estimasi Model Regresi Data Panel .....	72
4.1.5	Pengujian Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	74
4.1.6	Pengujian Hipotesis.....	75
4.1.7	Uji Sobel .....	78
4.2	Pembahasan.....	79

4.2.1	<i>Financial Distress, Mispricing, dan Return Saham pada Perusahaan Sektor Properti dan Real Estate yang Terdaftar di BEI</i> .....	79
4.2.2	Pengaruh <i>Financial Distress</i> terhadap <i>Return Saham pada Perusahaan Sektor Properti dan Real Estate yang Terdaftar di BEI</i> .....	81
4.2.3	Pengaruh <i>Financial Distress</i> terhadap <i>Mispricing</i> pada Perusahaan Sektor Properti dan <i>Real Estate</i> yang Terdaftar di BEI.....	83
4.2.4	Pengaruh <i>Mispricing</i> terhadap <i>Return Saham pada Perusahaan Sektor Properti dan Real Estate yang Terdaftar di BEI</i> .....	84
4.2.5	Pengaruh <i>Financial Distress</i> terhadap <i>Return Saham melalui Mispricing</i> sebagai Variabel Mediasi pada Perusahaan Sektor Properti dan <i>Real Estate</i> yang Terdaftar di BEI.....	86
<b>BAB V SIMPULAN DAN SARAN</b> .....		<b>88</b>
5.1	Simpulan .....	88
5.2	Saran.....	89
<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....		<b>92</b>
<b>LAMPIRAN</b> .....		<b>97</b>
<b>BIODATA PENULIS</b> .....		<b>136</b>