DAFTAR ISI

ABSTRACT.....i

ABSTRAK.....ii

KATA PENGANTAR.....iii

DAFTAR ISI.....vi

DAFTAR TABEL.....x

DAFTAR GAMBAR.....xiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian.....1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah.....9

1.2.1. Identifikasi Masalah.....9

1.2.2. Rumusan Masalah.....10

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian.....10

1.3.1. Maksud Penelitian.....10

1.3.2. Tujuan Penelitian.....11

1.4 Kegunaan Penelitian.....11

1.4.1 Kegunaan Praktis.....11

1.4.2 Kegunaan Akademis.....12

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian.....12

1.5.1 Lokasi Penelitian.....12

1.5.2 Waktu Penelitian.....14

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka 15

2.1.1 Market Value Added.....15

2.1.1.1 Pengertian Market Value Added 15

2.1.1.2 Konsep Market Value Added 17

2.1.1.3 Cara Peningkatakan Market Value Added 18

2.1.2 Beta Saham 19

2.1.2.1 Pengertian Beta Saham.....19

2.1.2.2 Penilaian Beta Saham 21

2.1.2.3 Resiko Sistematik dan Resiko Tidak Sistematik.....22

2.1.2.4 Variabel Yang Berhubungan Dengan Beta Saham 23

2.1.3 Return Saham.....27

2.1.3.1 Pengertian Return Saham 27

2.1.3.2 Faktor-faktor yang mempengaruhi Return Saham 29

2.1.4 Hasil Penelitian terdahulu 30

2.2 Kerangka Pemikiran.....39

2.2.1 Pengaruh Market Value Added Terhadap Return Saham.....40

2.2.2 Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham 41

2.2.3 Pengaruh Market Value Added Dan Beta Saham Terhadap Return Saham 41

2.2.4 Paradigma Penelitian 42

2.3 Hipotesis Penelitian 43

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian.....44

3.2 Metode Penelitian 44

3.2.1.Desain Penelitian 46

3.2.2.Operasionalisasi Variabel 52

3.2.3.Sumber dan teknik penentuan data 55

3.2.3.1 Sumber data 55

3.2.3.2 Teknik penentuan data.....56

3.2.4.Teknik pengumpulan data.....58

3.2.5.Rancangan analisis dan pengujian hipotesis.....59

3.2.5.1. Rancangan analisis deskriptif 59

3.2.5.2. Rancangan analisis verifikatif.....61

3.2.5.3. Pengujian Hipotesis 69

3.2.5.3.1 Pengujian Hipotesis secara parsial (Uji T).....70

3.2.5.3.2 Pengujian Hipotesis secara simultan (Uji F).....72

3.2.5.3.3 Penarikan Kesimpulan 74

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Gambaran Umum Perusahaan.....75

4.1.1. Sejarah Perusahaan 77

4.1.2. Stuktur Organisasi.....88

4.2 Analisis Deskriptif 96

4.2.1.Perkembangan *Market Value Added* (MVA) Perusahaan Manufaktur Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia 96
4.2.2.Perkembangan Beta Saham Perusahaan Manufaktur Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia.....105
4.2.3.Perkembangan *Return* Saham Perusahaan Manufaktur Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia.....114
4.3 Analisis Verifikatif.....122
4.3.1. Analisis Regresi Linear Berganda 122
4.3.2. Pengujian Asumsi Klasik.....124
4.3.3. Analisis Korelasi.....131
4.3.4. Koefisien Determinasi 133
4.3.5. Pengujian Hipotesis Parsial (Uji T) 134
4.3.6. Pengujian Hipotesis Simultan (Uji F).....138
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN
5.1 Kesimpulan 141
5.2 Saran 143
DAFTAR PUSTAKA.....xvi