DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

SURAT PERNYATAAN

MOTTO

ABSTRAK……….............……………………………………………..………....... i

ABSTRACT……………………………………………………..............……........ ii

KATA PENGANTAR ……………………………………………..…………........... iii

DAFTAR ISI ……………………………………………………………...………….. vi

DAFTAR TABEL ………………………………………………………..…........... x

DAFTAR GAMBAR ………………………………………..............………… xii

DAFTAR LAMPIRAN ……………………………………………...………… xiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian ……………………………….……………….. 1

1.2 Identifikasi Masalah ………………………………….………………... 9

1.3 Rumusan Masalah ……………………………………………..……... 10

1.4 Maksud Dan Tujuan Penelitian………………………………….…….….. 10

1.4.1 Maksud Penelitian……………………….…………….…...…... .. 10

1.4.2 Tujuan Penelitian……………………….………..………..….. 11

1.5 Kegunaan Penelitian…………………………………………………..... 11

1.5.1 Kegunaan Praktis……………………….………..………....... 12

1.5.2 Kegunaan Akademis……………………….………………….…...... 13

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka..... 14

2.1.1 Harga Per Nilai Buku (PBV)..... 14

2.1.1.1 Pengertian Harga Per Nilai Buku (PBV)..... 14

2.1.1.2 Indikator Harga Per Nilai Buku (PBV) 15

2.1.1.3 Komponen – Komponen (PBV) 16

2.1.2 *Return On Equity (ROE)* 20

2.1.2.1 Pengertian *Return On Equity (ROE)* 20

2.1.2.2 Indikator *Return On Equity (ROE)* 22

2.1.2.3 Faktor – Faktor *Return On Equity (ROE)* 24

2.1.3 *Return* Saham 25

2.1.3.1 Definisi *Return* Saham..... 25

2.1.3.2 Indikator *Return* Saham 26

2.1.3.3 Faktor –Faktor yang Mempengaruhi *Return* 29

2.2 Kerangka Pemikiran..... 30

2.2.1 Pengaruh (PBV) terhadap *Return* Saham 30

2.2.2 Pengaruh *(ROE)* terhadap *Return* Saham 31

2.3 Hipotesis Penelitian..... 34

BAB III METODELOGI PENELITIAN

3.1 Metode Penelitian..... 36

3.2 Operasionalisasi Variabel..... 38

3.3 Sumber Data..... 41

3.4 Populasi, Sample dan tempat serta Waktu Penelitian 42

3.4.1 Populasi 42

3.4.2 Pengambilan Semple 43

3.4.1 Tempat dan Waktu Penelitian..... 47

3.5 Metode Pengumpulan Data 48

3.6 Metode Pengujian Data 50

3.6.1 Rencana Analisis 50

3.6.2 Metode Pengujian Hipotesis 59

BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Analisis 64

4.1.1 Hasil Analisis Depkriptiftif 64

4.1.1.1 Hasil Analisis Deskriptif Harga Per Nilai Buku 65

4.1.1.2 Hasil Analisis Deskriptif *Return On Equity*.....72

4.1.1.3. Analisi Deskriptif *Return* Saham 78

4.1.2 Hasil Analisis Veripikatif 84

4.1.2.1 Uji Asumsi Klasik 85

1. Uji Normalitas 85

2. Uji Multikolinearitas 86

3. Uji Heteroskedastisitas 87

4. Uji Autokorelasi 87

4.1.2.2 Persamaan Regresi Linier Berganda 89

4.1.2.3 Analisis Koefisien Korelasi (R)..... 90

4.1.2.4 Koefisien Determinasi Secara Parsial..... 92

4.1.2.5 Pengujian Hipotesis Secara Parsial (Uji t)..... 93

4.2 Pembahasan..... 96

4.2.1 Pengaruh PBV Terhadap *Return* Saham 96

4.2.2 Pengaruh *ROE* Terhadap *Return* Saham 98

BAB V KESIMPULAN

5.1 Kesimpulan 100

5.2 Saran..... 102

5.2.1 Saran Praktis/Operasional..... 102

5.2.2 Saran Akademis..... 103

DAFTAR PUSTAKA..... 104

DAFTAR LAMPIRAN..... 108