DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN i

SURAT PERNYATAAN ii

ABSTRAK iii

***ABSTRACT* ..... iv**

KATA PENGANTAR v

DAFTAR ISI vii

DAFTAR TABEL xii

DAFTAR GAMBAR xiv

DAFTAR LAMPIRAN xv

BAB I PENDAHULUAN 1

1.1 Latar Belakang 1

1.2 Identifikasi Masalah 8

1.3 Rumusan Masalah 9

1.4 Maksud dan Tujuan Masalah 9

1.4.1 Maksud Penelitian 9

1.4.2 Tujuan Penelitian 10

1.5 Kegunaan Penelitian 10

1.5.1 Kegunaan Praktis 10

1.5.2 Kegunaan Akademis 11

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS 12

2.1 Kajian Pustaka 12

2.1.1 *Earning per Share* 12

2.1.1.1 Pengertian *Earning per Share* 12

2.1.1.2 Pengukuran *Earning per Share* 13

2.1.1.3 Indikator *Earning per Share* 14

2.1.1.4 Faktor yang Mempengaruhi *Earning per Share* 14

2.1.1.5 Faktor Penyebab Kenaikan dan Penurunan *Earning per Share* 15

2.1.2 *Debt to Equity Ratio* 16

2.1.2.1 Pengertian *Debt to Equity Ratio* 16

2.1.2.2 Pengukuran *Debt to Equity Ratio* 18

2.1.2.3 Indikator *Debt to Equity Ratio* 19

2.1.3 *Return* Saham 21

2.1.3.1 Pengertian *Return* Saham 21

2.1.3.2 Jenis-jenis *Return* Saham 22

2.1.3.3 Pengukuran *Return* Saham 23

2.1.3.4 Indikator *Return* Saham 24

2.2 Kerangka Pemikiran 24

2.2.1 Pengaruh *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham 24

2.2.2 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 27
2.3 Hipotesis Penelitian 30
BAB III METODOLOGI 31
3.1 Metode Penelitian 31
3.2 Operasional Variabel 34
3.3 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data 37
3.3.1 Sumber Data 37
3.3.2 Teknik Pengumpulan Data 38
3.4 Populasi, Sampel dan Tempat Serta Waktu Penelitian 39
3.4.1 Populasi 40
3.4.2 Sampel 40
3.4.3 Tempat dan Waktu Penelitian 42
3.5 Metode Pengujian Data 47
3.6 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis 47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... 56
4.1 Hasil Penelitian 56
4.1.1 Analisis Deskriptif 56
4.1.1.1 Analisis *Earning per Share* Pada Perusahaan Pertambangan Sub Sektor Batubara 56
4.1.1.2 Analisis *Debt to Equity Ratio* Pada Perusahaan Pertambangan Sub Sektor Batubara 59

4.1.1.3 Analisis *Return* Saham Pada Perusahaan Pertambangan Sub Sektor Batubara 63
4.1.2 Analisis Verifikatif..... 67
4.1.2.1 Uji Asumsi Klasik 71
4.1.3 Analisis Regresi Linier Berganda 67
4.1.4 Pengaruh *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham 73
4.1.4.1 Koefisien Korelasi (R) *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham..... 73
4.1.4.2 Koefisien Determinasi Parsial *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham 74
4.1.4.3 Pengujian Hipotesis *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham..... 74
4.1.5 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 76
4.1.5.1 Koefisien Korelasi (R) *Debt to equity Ratio* Terhadap *Return* Saham..... 76
4.1.5.2 Koefisien Determinasi Parsial *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham..... 77
4.1.5.3 Pengujian Hipotesis *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham..... 78
4.2 Pembahasan..... 79

4.2.1 Analisis Pengaruh *Earning per Share* Terhadap *Return* Saham 79

4.2.2 Analiis Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 82

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 85

5.1 Kesimpulan 85

5.2 Saran 85

DAFTAR PUSTAKA 87

LAMPIRAN-LAMPIRAN 92