DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL
JUDUL SKRIPSI
LEMBAR PENGESAHAN
SURAT PERNYATAAN
SURAT KETERANGAN PERSETUJUAN PUBLIKASI
MOTTO
ABSTRACT ..... **vi**
ABSTRAK ..... **vii**
KATA PENGANTAR ..... **viii**
DAFTAR ISI ..... **xii**
DAFTAR GAMBAR ..... **xvi**
DAFTAR TABEL ..... **xvii**
DAFTAR LAMPIRAN ..... **xviii**
BAB I PENDAHULUAN **1**
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 (*Applied Research*) 11
1.5.2 Kegunaan Akademis (*Basic Research*) 11
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS **12**
2.1 Kajian Pustaka 12
2.1.1 *Price to Book Value* 12
2.1.1.1 Pengertian *Price to Book Value* 12
2.1.1.2 Indikator *Price to Book Value* 13

2.1.2 *Debt to Equity Ratio* 14
2.1.2.1 Pengertian *Debt to Equity Ratio* 14
2.1.2.2 Indikator *Debt to Equity Ratio* 15
2.1.3 *Return* Saham 16
2.1.3.1 Pengertian *Return* Saham 16
2.1.3.2 Jenis-Jenis *Return* Saham 17
2.1.3.3 Indikator *Return* Saham 17
2.2 Kerangka Pemikiran 18
2.2.1 Pengruh *Price Book Value* (PBV) Terhadap *Return* Saham 18
2.2.2 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER) Terhadap *Return* Saham 19
2.3 Hipotesis 21
BAB III METODE PENELITIAN 22
3.1 Metode Penelitian 22
3.2 Operasional Variabel 23
3.3 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data 26
3.3.1 Sumber Data 26
3.3.2 Teknik Pengumpulan Data 27
3.4 Populasi, Sampel dan Tempat Serta Waktu Penelitian 28
3.4.1 Populasi 28
3.4.2 Penarikan Sampel 29
3.4.3 Tempat Serta Waktu Penelitian 31
3.5 Metode Pengujian Data 32
3.5.1 Uji Asumsi Klasik 32
3.5.5.1 Uji Normalitas 32
3.5.5.2 Uji Multikolinieritas 33
3.5.5.3 Uji Autokorelasi 34
3.5.5.4 Uji Heteroskedastisitas 36
3.6 Metode Analisis Data 37
3.6.1 Analisis Regresi Linier Berganda 37
3.6.2 Analisis Korelasi 38

3.6.3 Pengujian Determinasi (R^2) 40
3.6.4 Pengujian Hipotesis 40
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 45
4.1 Hasil Penelitian 45
4.1.1 Hasil Analisis Deskriptif 45
4.1.1.1 Gambaran *Price Book Value* (PBV) Tahun 2010-2104 46
4.1.1.2 Gambaran *Debt to Equity Ratio* (DER) Tahun 2010-2014 50
4.1.1.3 Gambaran *Return* Saham Tahun 2010-2014 55
4.1.2 Hasil Analisis Verifikatif 60
4.1.2.1 Uji Asumsi Klasik 60
4.1.2.1.1 Uji Normalitas 60
4.1.2.1.2 Uji Multikolinieritas 61
4.1.2.1.3 Uji Autokorelasi 62
4.1.2.1.4 Uji Heteroskedastisitas 63
4.1.2.2 Persamaan Regresi Linier Berganda 66
4.1.2.3 Analisis Korelasi 67
4.1.2.4 Analisis Koefisien Determinasi 69
4.1.2.4.1 Analisis Koefisien Determinasi Parsial *Price Book Value* Terhadap *Return* Saham . 69
4.1.2.4.2 Analisis Koefisien Determinasi Parsial *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 70
4.1.2.5 Pengujian Hipotesis 71
4.1.2.5.1 Pengujian Hipotesis Parsial *Price Book Value* Terhadap *Return* Saham 71
4.1.2.5.2 Pengujian Hipotesis Parsial *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 72
4.2 Pembahasan 74
4.2.1 Pengaruh *Price Book Value* Terhadap *Return* Saham 74

4.2.2 Pengaruh *Debt to Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham 75
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 78
5.1 Kesimpulan 78
5.2 Saran 79
5.1.1 Saran Operasional 79
5.1.2 Saran Akademis 79
DAFTAR PUSTAKA 80
LAMPIRAN 83