

DAFTAR ISI

| | |
|--|------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI..... | ii |
| HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN | iii |
| HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI..... | iv |
| MOTO DAN HALAMAN PERSEMBAHAN | v |
| ABSTRACT..... | vi |
| ABSTRAK..... | vii |
| KATA PENGANTAR | viii |
| DAFTAR TABEL..... | xiv |
| DAFTAR GAMBAR | xv |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | xvi |
| | |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 12 |
| 1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian..... | 13 |
| 1.3.1 Tujuan Penelitian | 13 |
| 1.3.4 Kegunaan Penelitian | 14 |
| 1.4 Sistematika Penulisan..... | 15 |
| | |
| BAB II TINJAUAN PUSTAKA | 16 |
| 2.1 Definisi | 16 |
| 2.1.1 <i>Return Saham</i> | 16 |
| 2.1.2 <i>Current Ratio</i> | 16 |
| 2.1.3 <i>Debt to Equity Ratio</i> | 18 |
| 2.1.4 <i>Return On Equity</i> | 19 |
| 2.1.5 <i>Total Asset Turnover</i> | 20 |
| 2.1.6 <i>Price to Book Value</i> | 21 |
| 2.2 Landasan Teori | 22 |

| | |
|---|----|
| 2.2.1 Fama and French Three Factor Model Theory | 22 |
| 2.2.2 Carhart Four Factor Model Theory | 22 |
| 2.2.3 <i>Business Cycle Theory</i> | 23 |
| 2.3 Penelitian Terdahulu | 24 |
| 2.4 Perbedaan Penelitian | 38 |
| 2.5 Pengaruh Antar Variabel | 42 |
| 2.5.1 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 42 |
| 2.5.2 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 42 |
| 2.5.3 Pengaruh <i>Return On Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 43 |
| 2.5.4 Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 44 |
| 2.5.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> terhadap <i>Return Saham</i> | 45 |
| 2.6 Kerangka Pemikiran | 46 |
| 2.7 Hipotesis..... | 47 |
| | |
| BAB III METODE PENELITIAN | 48 |
| 3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional | 48 |
| 3.1.1 Variabel Dependen | 48 |
| 3.1.2 Variabel Independen..... | 48 |
| 3.1.3 Definisi Operasional | 50 |
| 3.2 Populasi dan Sampel | 52 |
| 3.2.1 Populasi | 52 |
| 3.2.2 Sampel | 52 |
| 3.3 Jenis dan Sumber Data | 53 |
| 3.4 Metode Pengumpulan Data | 53 |
| 3.5 Metode Analisis..... | 53 |
| 3.5.1 Uji Asumsi Klasik | 54 |
| 3.5.1.1 Uji Normalitas..... | 54 |
| 3.5.1.2 Uji Multikolonieritas..... | 55 |
| 3.5.1.3 Uji Autokorelasi..... | 56 |
| 3.5.1.4 Uji Heteroskedastisitas..... | 56 |
| 3.5.2 Analisis Regresi | 57 |
| 3.5.2.1 Uji Determinasi (R^2) | 58 |

| | |
|--|-----------|
| 3.5.2.2 Uji Statistik F | 58 |
| 3.5.2.3 Uji Statistik t | 59 |
| BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN | 60 |
| 4.1 Deskripsi Objek Penelitian..... | 60 |
| 4.2 Analisis Data | 60 |
| 4.2.1 Analisis Deskriptif Statistik..... | 60 |
| 4.2.2 Uji Asumsi Klasik | 64 |
| 4.2.2.1 Uji Multikolinieritas..... | 64 |
| 4.2.2.2 Uji Autokorelasi..... | 65 |
| 4.2.2.3 Uji Heteroskedastisitas..... | 66 |
| 4.2.2.4 Uji Normalitas..... | 68 |
| 4.2.3 Analisis Regresi Linier Berganda..... | 70 |
| 4.2.4 Uji Hipotesis | 73 |
| 4.2.4.1 Uji Koefisien Determinasi (<i>Adjusted R²</i>)..... | 73 |
| 4.2.4.2 Uji Signifikan Simultan (Uji Statistik F) | 74 |
| 4.2.4.3 Uji Signifikan Parameter Individual (Uji Statistik t) | 76 |
| 4.2.5 Pembahasan | 76 |
| 4.2.5.1 Pembahasan Hasil Hipotesis Pertama..... | 76 |
| 4.2.5.2 Pembahasan Hasil Hipotesis Kedua..... | 78 |
| 4.2.5.3 Pembahasan Hasil Hipotesis Ketiga | 79 |
| 4.2.5.4 Pembahasan Hasil Hipotesis Keempat..... | 80 |
| 4.2.5.5 Pembahasan Hasil Hipotesis Kelima | 81 |
| BAB V PENUTUP | 84 |
| 5.1 Kesimpulan..... | 84 |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian | 86 |
| 5.3 Saran..... | 86 |
| 5.3.1 Saran untuk Penelitian Selanjutnya | 86 |
| 5.3.2 Saran bagi Investor | 87 |
| DAFTAR PUSTAKA | 88 |