

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
HALAMAN MOTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	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	8
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	11
1.4 Sistematika Penulisan	12
BAB II TELAAH PUSTAKA	14
2.1 Landasan Teori	14
2.1.1 Arbitrage Pricing Theory (APT)	16
2.1.2 Pengertian Pasar Modal	17
2.1.3 Harga Saham	19
2.1.4 Konsep Return Dalam Saham	20
2.1.5 <i>Debt to Equity Ratio</i>	22
2.1.6 <i>Return On Asset (ROA)</i>	23
2.1.7 <i>Price to Book Value</i>	24
2.1.8 Volume Perdagangan	25
2.1.9 Kapitalisasi Pasar	25
2.2 Penelitian Terdahulu	26
2.3 Pengaruh Antara Variabel Dependen dan Independen	33
2.3.1 Pengaruh Volume perdagangan terhadap Return Saham	33
2.3.2 Pengaruh Debt To Equity Ratio (DER) terhadap Return Saham	33
2.3.3 Pengaruh Price to Book Value terhadap Return Saham	34
2.3.4 Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap Return	

Saham.....	35
2.3.5 Pengaruh Return On Asset (ROA) terhadap Return Saham	36
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	37
2.5 Hipotesis Penelitian.....	38
BAB III METODE PENELITIAN	39
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	39
3.1.1 Volume Perdagangan.....	39
3.1.2 Debt to Equity Ratio.....	40
3.1.3 Price To Book Value.....	40
3.1.4 Kapitalisasi Pasar.....	40
3.1.5 Return on Asset	41
3.2 Populasi dan Sampel	42
3.2.1 Populasi.....	42
3.2.2 Sampel	43
3.3 Jenis dan Sumber Data	44
3.4 Metode Pengumpulan Data	45
3.5 Metode Analisis	45
3.5.1 Uji Asumsi Klasik	46
3.5.1.1 Uji Normalitas	46
3.5.1.2 Uji Multikolinearitas	47
3.5.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	47
3.5.1.4 Uji Autokorelasi.....	48
3.5.2 Analisis Regresi Berganda.....	49
3.5.3 Pengujian Hipotesis	50
3.5.3.1 Uji Statistik F.....	50
3.5.3.2 Uji Statistik t.....	51
3.5.3.3 Koefisien Determinasi.....	51
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	53
4.1 Deskripsi Obyek Penelitian	53
4.1.1 Gambaran Umum Obyek Penelian.....	53
4.1.2 Statistik Deskripsi Variabel Penelitian.....	53
4.2 Analisis Data.....	57
4.2.1 Uji Asumsi Klasik	57
4.2.1.1 Uji Normalitas	58
4.2.1.2 Uji Multikolinearitas.....	61
4.2.1.3 Uji Heteroskedastisitas.....	63
4.2.1.3 Uji Autokorelasi	66
4.3 Interpretasi Hasil.....	67
4.3.1 Uji Statistik F	67

4.3.2	Regresi untuk Return Saham sebagai Variabel Independen.....	68
4.4	Pengujian Hipotesis Parsial.....	71
4.4.1	Uji Hipotesis antara Volume Trading terhadap Return saham.....	71
4.4.2	Uji Hipotesis antara Debt to equity ratio terhadap Return saham.....	72
4.4.3	Uji Hipotesis antara Price to Book Value terhadap Return saham	72
4.4.4	Uji Hipotesis antara Capitalisasi Pasar terhadap Return Saham.....	73
4.4.5	Uji Hipotesis antara Return on Asset terhadap Return Saham.....	74
4.5	Uji Koefisien Determinasi.....	74
4.6	Pembahasan.....	75
BAB V PENUTUP		79
5.1	Simpulan.....	79
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	80
5.3	Saran.....	81
DAFTAR PUSTAKA.....		83
LAMPIRAN – LAMPIRAN		86