

## DAFTAR ISI

Halaman Judul	
Sertifikasi	i
Abstrak	ii
Abstract	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Gambar	ix
Daftar Tabel	x
Daftar Rumus	xi
Daftar Lampiran	xii
<b>Bab I. PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	12
1.3 Tujuan Penelitian	15
1.4 Kegunaan Penelitian	16
<b>Bab II. LANDASAN TEORI</b>	
2.1. Telaah Pustaka	18
2.1.1 Indeks Papan Utama dan Indeks Papan Pengembangan	18
2.1.2. <i>Beta</i> Saham	20
2.1.3 <i>Size</i> (ukuran) Perusahaan	21
2.1.4 <i>Debt Equity Ratio</i>	22
2.1.5 <i>Price to Book Value Ratio</i>	24
2.1.6 Return	25
2.2 Hubungan Variabel Independen dengan Variabel Dependen	27
2.2.1 Pengaruh Beta Saham terhadap Return Saham	27

2.2.2 Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap Return Saham	28
2.2.3 Pengaruh <i>Debt Equity Ratio (DER)</i> terhadap Return Saham	29
2.2.4 Pengaruh <i>Price to Book Ratio (PBV)</i> terhadap Return Saham	30
2.3 Penelitian Terdahulu	31
2.4 Perbedaan dengan Penelitian Terdahulu	32
2.5 Kerangka Pemikiran Teoritis	34
2.6 Perumusan Hipotesis	37

### **Bab III. METODE PENELITIAN**

3.1. Jenis dan Sumber Data	38
3.2. Populasi dan Sampel	38
3.3. Definisi Operasional	39
1. <i>Beta Saham</i>	39
2. Ukuran Perusahaan	40
3. <i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	40
4. <i>Price to Book Value (PBV)</i>	40
5. <i>Return Saham</i>	41
3.4 Uji Asumsi Klasik	
3.4.1 Uji Normalitas	42
3.4.2 Uji Autokorelasi	42
3.4.1 Uji Multikolinearitas	43
3.4.1 Uji Heterokedastisitas	43
3.5 Teknik Analisa	43

### **Bab IV. HASIL DAN PEMBAHSAN**

4.1 Gambaran Umum dan Deskripsi Data Obyek Penelitian	46
4.1.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian	46

4.1.2 Deskripsi Statistik Variabel Penelitian	47
4.2 Analisis Data	49
4.2.1 Perhitungan Rasio-Rasio Keuangan	49
4.3 Uji Asumsi Klasik	49
4.3.1 Uji Normalitas	49
4.3.2 Uji Multikolinearitas	51
4.3.3 Uji Autokorelasi	52
4.3.4 Uji Heterokedastisitas	52
4.4 Hasil Analisis Regresi	53
4.5 Koefisien Determinasi ( $R^2$ )	54
4.6 Uji F	55
4.7 Uji t (Penguujian Hipotesis)	55
4.7.1 Pengujian Hipotesis 1	56
4.7.2 Pengujian Hipotesis 2	57
4.7.3 Pengujian Hipotesis 3	58
4.7.4 Pengujian Hipotesis 4	59
4.7.5 Pengujian Hipotesis 5	60
<b>Bab V. KESIMPULAN DAN IMPLIKASI HASIL PENELITIAN</b>	
5.1 Kesimpulan	63
5.2 Implikasi Hasil Penelitian	65
5.2.1 Implikasi Teoritis	65
5.2.2 Implikasi Kebijakan	67
5.3 Keterbatasan Penelitian	71
5.4 Agenda Penelitian Mendatang	71
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	72
Lampiran	
Daftar Riwayat Hidup	