

DAFTAR ISI

Halaman Sampul	i
Halaman Judul.....	ii
Lembar Persetujuan.....	iii
Pengesahan.....	iv
Pernyataan Keaslian Tulisan	v
Surat Pernyataan Kesiapan Publikasi Karya Ilmiah.....	vi
Motto	vii
Persembahan	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar Isi.....	xi
Daftar Tabel	xiv
Daftar Gambar.....	xv
Daftar Lampiran	xvi
Abstrak	xvii
Abstract	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	19
C. Rumusan Masalah.....	19
D. Tujuan Penelitian	20
E. Kegunaan Penelitian	21
1. Manfaat Teoritis.....	21
2. Manfaat Praktis	21
F. Ruang Lingkup Penelitian.....	22
G. Penegasan Variabel.....	23
1. Penegasan Operasional	23
2. Penegasan Konseptual	25
H. Sistematika Penulisan	27

BAB II LANDASAN TEORI	29
A. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	29
B. Harga Saham.....	30
1. Pengertian Harga Saham.....	30
2. Pengelompokan Harga Saham	32
3. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	33
C. <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	37
1. Faktor yang Mempengaruhi EPS	38
2. Parameter <i>Earning Per Share</i>	38
D. <i>Price to Book Value</i>	40
E. <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	42
F. Penelitian Terdahulu	44
G. Kerangka Konseptual.....	53
H. Hipotesis Penelitian	53
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	55
A. Pendekatan dan Jenis Penelitian	55
1. Pendekatan Penelitian	55
2. Jenis Penelitian	55
B. Populasi, Sampling dan Sampling Penelitian	56
1. Populasi Penelitian.....	56
2. <i>Sampling</i>	56
3. <i>Sampling</i> Penelitian	57
C. Sumber Data, Variabel, dan Skala Pengukuran	58
1. Sumber data	58
2. Variabel.....	58
3. Skala Pengukuran	59
D. Teknik Pengumpulan Data.....	60
E. Analisis Data.....	60
1. Uji Asumsi Klasik.....	61
2. Uji Regresi Data Panel.....	63
3. Metode Estimasi Data Panel	64

4. Tahapan Analisis Data Panel	65
5. Uji Hipotesis	67
BAB IV HASIL PENELITIAN	70
A. Gambaran Umum Perusahaan Sektor Industri.....	70
1. PT Astra International.....	70
2. Indah Kiat Pulp & Paper	71
3. Semen Indonesia (Persero) Tbk.....	72
4. Aneka Tambang.....	73
5. United Tractors	74
B. Pengujian Hipotesis	76
1. Uji Pemilihan Model.....	76
2. Uji Asumsi Klasik.....	78
3. Uji Hipotesis	82
4. Hasil Uji Statistik.....	88
BAB V PEMBAHASAN HASIL PENELITIAN	89
A. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS), <i>Price to Book Value</i> (PBV), dan <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap Harga Saham	89
B. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap Harga Saham	91
C. Pengaruh <i>Price to Book Value</i> (PBV) terhadap Harga Saham	94
D. Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap Harga Saham	96
BAB VI PENUTUP	100
A. Kesimpulan	100
B. Saran	101
1. Bagi Perusahaan.....	101
2. Bagi Akademik	101
3. Bagi Peneliti Selanjutnya.....	102
DAFTAR PUSTAKA	103
LAMPIRAN	110

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Kriteria Pengambilan Sampel	57
Tabel 4.1 Hasil Uji Chow.....	77
Tabel 4.2 Hasil Uji Hausman.....	78
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas	79
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas.....	80
Tabel 4.5 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	81
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokolerasi	82
Tabel 4.7 Hasil Uji T (Parsial).....	83
Tabel 4.8 Hasil Uji F (Simultan).....	86
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefisiensi Determinasi	87

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual	53
Gambar 4.1 Hasil Uji Statistik.....	88

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Penelitian.....	110
Lampiran 2. Hasil Olah Data (Output Eviews12).....	114
Lampiran 3. Kartu Bukti Bimbingan Skripsi	117
Lampiran 4. Daftar Riwayat Hidup.....	132