

DAFTAR ISI

| | |
|---|-----|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PENGESAHAN | ii |
| PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI | iii |
| MOTTO DAN PERSEMBAHAN | iv |
| ABSTRAK | v |
| KATA PENGANTAR | vii |
| DAFTAR ISI..... | ix |
| DAFTAR TABEL | xii |
| BAB I PENDAHULUAN | |
| 1.1. Latar Belakang Penelitian..... | 1 |
| 1.2. Rumusan Masalah | 9 |
| 1.3. Tujuan Penelitian..... | 10 |
| 1.4. Manfaat Penelitian..... | 10 |
| 1.4.1 Manfaat Teoritis | 10 |
| 1.4.2 Manfaat Praktis..... | 11 |
| BAB II KAJIAN PUSTAKA | |
| 2.1. Landasan Teori..... | 12 |
| 2.1.1. <i>Fundamental Analysis</i> | 12 |
| 2.1.2. Harga Saham | 15 |
| 2.1.2.1. Pengertian Saham | 15 |
| 2.1.2.2. Teori Harga Saham | 16 |
| 2.1.3. Penilaian Tingkat Kesehatan Bank | 17 |

| | | |
|------|----------------------------------|----|
| 2.2. | Penelitian Terdahulu..... | 30 |
| 2.3. | Kerangka Pemikiran Teoritis..... | 33 |
| 2.4. | Hipotesis..... | 35 |

BAB III METODE PENELITIAN

| | | |
|----------|--|----|
| 3.1 | Konstruk Penelitian | 40 |
| 3.1.1 | Varibel Tidak Bebas (<i>Dependent Variable</i>) | 40 |
| 3.1.2 | Variabel Tidak Terikat (<i>Independent Variable</i>) | 40 |
| 3.2 | Definisi Operasional Variabel Penelitian | 42 |
| 3.3 | Populasi dan Sampel..... | 46 |
| 3.3.1 | Populasi..... | 46 |
| 3.3.2 | Sampel..... | 46 |
| 3.4 | Jenis dan Sumber Data | 47 |
| 3.5 | Metode Pengumpulan Data | 48 |
| 3.6 | Metode Analisis Data | 48 |
| 3.6.1 | Analisis Statistik Deskriptif | 48 |
| 3.6.2 | Analisis Regresi Panel | 48 |
| 3.6.2.1. | Estimasi Model Regresi Data Panel..... | 49 |
| 3.6.2.2. | Pemilihan Model Regresi Data Panel | 51 |
| 3.6.2.3. | Uji Asumsi Regresi Data Panel..... | 53 |
| 3.6.2.4. | Uji Kesesuaian Model..... | 54 |
| 3.6.3 | Uji parameter Individual (Uji t)..... | 55 |

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

| | | |
|--------|---|----|
| 4.1 | Deskripsi Hasil Penelitian | 56 |
| 4.2 | Analisis Hasil Penelitia..... | 59 |
| 4.2.1. | Estimasi Model Regresi Data Panel | 59 |
| 4.2.2. | Pemilihan Model Regresi Data Panel..... | 63 |

| | |
|--|----|
| 4.2.3. Uji Asumsi Model Regresi Data Panel | 65 |
| 4.2.3.1. Model Awal | 65 |
| 4.2.3.2. Model Revisi Pertama..... | 66 |
| 4.2.4. Uji Goodness of Fit (Uji f)..... | 70 |
| 4.2.5. Uji Signifikansi Parameter individual (Uji t)..... | 70 |
| 4.3 Pembahasan | 72 |
| 4.3.1. Pengaruh Resiko kredit terhadap harga saham | 73 |
| 4.3.2. Pengaruh Risiko Likuiditas terhadap harga saham | 74 |
| 4.3.3. Pengaruh GCG terhadap Harga Saham..... | 74 |
| 4.3.4. Pengaruh Earning Terhadap Harga Saham | 75 |
| 4.3.5. Pengaruh Capital Terhadap Harga Saham | 75 |

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

| | |
|------------------------|----|
| 5.1 Kesimpulan | 77 |
| 5.2 Implikasi | 78 |
| 5.3 Keterbatasan | 91 |
| 5.4 Saran | 92 |

DAFTAR PUSTAKA

DAFTAR TABEL

| | | |
|------------|---|----|
| TABEL 1.1 | Riset Gap..... | 8 |
| TABEL 2.1 | Penelitian Terdahulu | 31 |
| TABEL 3.1 | Penilaian Tingkat GCG | 44 |
| TABEL 3.2 | Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel | 45 |
| TABEL 4.1 | Analisis Hasil Deskriptif | 57 |
| TABEL 4.2 | Hasil Estimasi Model <i>Common Effect</i> | 59 |
| TABEL 4.3 | Hasil Estimasi Model <i>Fixed Asset</i> | 60 |
| TABEL 4.4 | Hasil Uji Statistik Variabel Dummy | 61 |
| TABEL 4.5 | Hasil Estimasi <i>Random Effect</i> | 62 |
| TABEL 4.6 | Hasil Uji Model <i>Chow Test</i> | 63 |
| TABEL 4.7 | Hasil Uji Model <i>Hausman Test</i> | 64 |
| TABEL 4.8 | Hasil Uji Model <i>Lagrange Multiplier Test</i> | 65 |
| TABEL 4.9 | Hasil Uji Normalitas..... | 66 |
| TABEL 4.10 | Hasil Estrimasi Model <i>Fixed Effect</i> | 67 |
| TABEL 4.11 | Hasil Uji Normalitas | 67 |
| TABEL 4.12 | Hasil Uji Multikolonieritas..... | 68 |
| TABEL 4.13 | Hasil Uji Autokorelasi..... | 69 |
| TABEL4.14 | Hasil Uji Heteroskedisitas..... | 69 |
| TABEL 4.15 | Hasil Uji Statistik t Variabel Independen..... | 71 |
| TABEL 4.16 | Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis | 73 |