

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN UJIAN SKRIPSI .....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI .....	iv
HALAMAN PERSETUJUAN PUBLIKASI .....	v
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	vi
ABSTRAKSI.....	vii
ABSTRACT .....	viii
INTISARI.....	ix
KATA PENGANTAR .....	x
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xvii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	6
1.3 Tujuan Penelitian .....	6
1.4 Kontribusi dan Manfaat Penelitian.....	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA .....	8
2.1 Landasan Teori.....	8
2.1.1 Teori Sinyal (Signaling Theory).....	8
2.1.2 Pasar Modal.....	9
2.1.3 Saham .....	10

2.1.4	Harga Saham .....	11
2.1.5	Nilai Saham .....	12
2.1.6	Analisis Penilaian Harga Saham .....	13
2.1.7	Rasio Keuangan.....	14
2.1.8	Rasio Profitabilitas .....	15
2.1.8.1	Return On Equity (ROE) .....	16
2.1.8.2	Return On Asset (ROA).....	17
2.1.8.3	Earning Per Share (EPS).....	17
2.2	Penelitian terdahulu.....	18
2.3	Hipotesis.....	19
2.3.1	<i>Return On Equity</i> (ROE) .....	19
2.3.2	<i>Return On Asset</i> (ROA).....	20
2.3.3	<i>Earning Per Share</i> (EPS) .....	20
2.3.4	Inflasi.....	21
2.3.5	Harga Minyak Dunia .....	23
2.4	Kerangka Teoritis.....	24
BAB III METODE PENELITIAN .....		26
3.1	Jenis Penelitian.....	26
3.2	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	26
3.2.1	Variabel Dependen (Y) : Harga Saham.....	26
3.2.2	Variabel Independen.....	27
3.2.2.1	Return On Equity (ROE) .....	27
3.2.2.2	Return On Asset.....	27
3.2.2.3	Earning Per Share .....	28
3.2.2.4	Inflasi .....	28

3.2.2.5	Harga Minyak Dunia .....	29
3.3	Populasi dan Sampel .....	29
3.4	Jenis dan Sumber Data.....	30
3.5	Metode pengumpulan data .....	30
3.6	Metode Analisis Data.....	31
3.6.1	Statistik Deskriptif.....	31
3.6.2	Uji Asumsi Klasik .....	31
3.6.2.1	Uji Normalitas Data.....	32
3.6.2.2	Uji Multikolinearitas.....	32
3.6.2.3	Uji Heterokedastisitas .....	33
3.6.2.4	Uji Autokorelasi.....	34
3.6.3	Uji Analisis Regresi Berganda .....	34
3.6.4	<i>Goodnes Of Fit Model</i> (Uji Kelayakan Model).....	35
3.6.4.1	Uji Koefisien Determinasi .....	35
3.6.4.2	Uji F (Uji Siginifikan Simultan) .....	36
3.6.5	Uji Hipotesis.....	36
3.6.5.1	Uji t (t-Test) .....	37
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>38</b>
4.1	Hasil Penelitian .....	38
4.1.1	Sampel Penelitian .....	38
4.2	Analisis Data .....	39
4.2.1	Statistik Deskriptif.....	39
4.2.2	Uji Asumsi Klasik .....	41
4.2.2.1	Uji Normalitas Data.....	41
4.2.2.2	Uji Multikolinearitas.....	44

4.2.2.3	Uji Heterokedastisitas .....	45
4.2.2.4	Uji Autokorelasi.....	46
4.2.3	Uji Analisis Regresi Berganda .....	47
4.2.4	Goodness of Fit Model (Uji Kelayakan Model).....	50
4.2.4.1	Uji Koefisien Determinasi .....	50
4.2.4.2	Uji F (Uji Siginifikan Simultan).....	51
4.2.5	Uji Hipotesis.....	52
4.2.5.1	Uji t.....	52
4.3	Pembahasan.....	54
4.3.1	Pengaruh Return On Equity (ROE) terhadap Harga Saham .....	54
4.3.2	Pengaruh <i>Return On Asset</i> (ROA) terhadap Harga Saham .....	55
4.3.3	Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap Harga Saham.....	56
4.3.4	Pengaruh Inflasi terhadap Harga Saham .....	57
4.3.5	Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Harga Saham.....	58
BAB V PENUTUP.....		60
5.1	Kesimpulan .....	60
5.2	Saran.....	61
5.3	Keterbatasan Penelitian dan Agenda Penelitian Mendatang.....	62
DAFTAR PUSTAKA .....		63

**DAFTAR TABEL**

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	18
Tabel 4.1 Kriteria Sampel .....	38
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Data Penelitian .....	40
Tabel 4.3 Uji Normalitas Komogorov-Smirnov (KS) .....	43
Tabel 4.4 Uji Multikolinearitas .....	44
Tabel 4.5 Uji Heterokedastisitas Glejser .....	46
Tabel 4.6 Uji Autokorelasi Durbin Watson .....	47
Tabel 4.7 Uji Analisis Regresi Berganda .....	48
Tabel 4.8 Uji Koefisien Determinasi .....	50
Tabel 4.9 Uji F .....	51
Tabel 4.10 Uji t.....	53

**DAFTAR GAMBAR**

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Penelitian .....	25
Gambar 4.1 Uji Normalitas P Plot .....	42
Gambar 4.2 Uji Heterokedastisitas Pola Scatterplot .....	45

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Daftar Perusahaan Sampel

Lampiran 2 : Data Mentah Harga Saham

Lampiran 3 : Data Mentah *Return On Equity* (ROE)

Lampiran 4 : Data Mentah *Return On Asset* (ROA)

Lampiran 5 : Data Mentah *Earning Per Share* (EPS)

Lampiran 6 : Data Mentah Inflasi

Lampiran 7 : Data Mentah Harga Minyak Dunia

Lampiran 8 : Hasil Pengolahan Data SPSS