

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
<i>ABSTRACT</i>	xv
ABSTRAKSI	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	8
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Teory Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	10
2.1.2 <i>Efficient Market Theory (Efficient Market Hypothesis/EMH.</i>	11
2.2 Variabel-variabel Penelitian dan Pengembangan Hipotesis	12
2.2.1 Variabel-variabel Penelitian	12
2.2.1.1 Harga Saham	12
2.2.1.2 <i>Return On Investment (ROI)</i>	16
2.2.1.3 <i>Earning Per Share (EPS)</i>	17

2.2.1.4 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER)	19
2.2.1.5 <i>Perceived Risk</i> Saham	20
2.2.2 Pengembangan Hipotesis.....	24
2.2.2.1 Pengaruh ROI terhadap Harga Saham	24
2.2.2.2 Pengaruh EPS terhadap Harga Saham	25
2.2.2.3 Pengaruh DER terhadap Harga Saham	25
2.2.2.4 Pengaruh <i>Perceived Risk</i> pada Hubungan ROI terhadap Harga Saham	26
2.2.2.5 Pengaruh <i>Perceived Risk</i> pada Hubungan EPS terhadap Harga Saham	27
2.2.2.6 Pengaruh <i>Perceived Risk</i> pada Hubungan DER terhadap Harga Saham	28
2.3 Model Empirik.....	29
BAB III METODE PENELITIAN.....	30
3.1 Jenis Penelitian	30
3.2 Populasi dan Sampel.....	30
3.2.1 Populasi	30
3.2.2 Sampel	31
3.3 Sumber dan Metode Pengumpulan Data	31
3.3.1 Sumber Data	31
3.3.2 Metode Pengumpulan Data	31
3.4 Variabel dan Indikator	32
3.4.1 Variabel Dependen (Y).....	32
3.4.2 Variabel Independen (X)	32
3.4.3 Variabel Moderasi (Z)	32
3.5 Teknik Analisis Data	35
3.5.1 Analisis Deskriptif.....	36

3.5.2 Analisis Statistik (Uji Asumsi Klasik)	36
3.5.3 Analisis Regresi	38
3.5.4 Uji Hipotesis	40
3.5.5 Koefisien Determinasi	41
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	42
4.2 Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	42
4.2.1 Statistik Deskriptif	42
4.2.2 Analisis Statistik	53
4.2.2.1 Hasil Uji Asumsi Klasik	53
4.2.2.2 Hasil Uji Hipotesis	60
4.2.2.3 Hasil Uji t	67
4.2.2.4 Hasil Uji Koefisien Determinasi	70
4.3 Pembahasan	71
4.3.1 ROI Berpengaruh Negatif Terhadap Harga Saham	71
4.3.2 EPS Berpengaruh Positif Terhadap Harga Saham	73
4.3.3 DER Berpengaruh Negatif terhadap Harga Saham	74
4.3.4 <i>Perceived Risk</i> Tidak Berpengaruh pada Hubungan ROI terhadap Harga Saham	76
4.3.5 <i>Perceived Risk</i> Tidak Berpengaruh pada Hubungan EPS terhadap Harga Saham	77
4.3.6 <i>Perceived Risk</i> Tidak Berpengaruh pada Hubungan DER terhadap Harga Saham	77
4.4 Temuan Hasil Penelitian	71
BAB V PENUTUP	79
5.1 Kesimpulan	79
5.2 Keterbatasan Penelitian	80
5.3 Saran	80
DAFTAR PUSTAKA	82
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Harga Saham Perusahaan Pertambangan Yang Terdaftar di BEI Periode 2011-2015	6
Tabel 3.1	Definisi Operasional Variabel Penelitian.....	33
Tabel 4.1	Sampel Penelitian.....	42
Tabel 4.2	Deskriptif Variabel Penelitian.....	43
Tabel 4.3	Rata-rata ROI Tahun 2011-2015.....	44
Tabel 4.4	Rata-rata EPS Tahun 2011-2015.....	46
Tabel 4.5	Rata-rata DER Tahun 2011-2015	48
Tabel 4.6	Rata-rata PR Tahun 2011-2015.....	50
Tabel 4.7	Rata-rata Harga Saham Tahun 2011-2015.....	52
Tabel 4.8	Hasil Uji Normalitas Persamaan 1	54
Tabel 4.9	Hasil Uji Normalitas Persamaan 2	54
Tabel 4.10	Hasil Uji Normalitas Persamaan 3	55
Tabel 4.11	Hasil Uji Multikolonieritas Persamaan 1	56
Tabel 4.12	Hasil Uji Multikolonieritas Persamaan 2	56
Tabel 4.13	Hasil Uji Multikolonieritas Persamaan 3	57
Tabel 4.14	Hasil Uji Heteroskedastisitas Persamaan 1	57
Tabel 4.15	Hasil Uji Heteroskedastisitas Persamaan 2	58
Tabel 4.16	Hasil Uji Heteroskedastisitas Persamaan 3	58
Tabel 4.17	Hasil Uji Autokorelasi	59
Tabel 4.18	Hasil Uji Autokorelasi dengan Uji <i>Runs Test</i>	60
Tabel 4.19	Hasil Uji Parsial Regresi Berganda.....	67
Tabel 4.20	Hasil Uji Moderating	69

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Model Penelitian	29
Gambar 4.1 Model Persamaan 1	60
Gambar 4.2 Model Persamaan 2	62
Gambar 4.3 Model Persamaan 3	63
Gambar 4.4 Temuan Hasil Penelitian	78

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Sampel Perusahaan Pertambangan Yang Terdaftar di BEI Tahun 2011-2015.
- Lampiran 2 *Z-Score* Perusahaan Pertambangan Tahun 2011-2015.
- Lampiran 3 Tabulasi Data.
- Lampiran 4 Hasil Deskripsi Data Penelitian
- Lampiran 5 Hasil Uji Asumsi Klasik
- Lampiran 6 Uji Hipotesis