

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS ILMIAH SKRIPSI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB 1. PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	7
BAB 2. TINJAUAN PUSTAKA	9
A. Landasan Teori	9
1. Saham	9
2. Harga Saham	12
3. <i>Return On Investment</i>	14

4. <i>Earning Per Share</i>	16
5. <i>Price Earning Ratio</i>	16
B. Penelitian Terdahulu	17
C. Kerangka Konseptual	20
D. Pengaruh Antar Variabel	20
E. Hipotesis Penelitian	23
BAB III. METODE PENELITIAN	24
A. Rancangan Penelitian	24
B. Obyek Penelitian	24
C. Populasi	24
D. Sampel dan Teknik <i>Sampling</i>	25
E. Jenis dan Metode Pengumpulan Data	25
F. Klasifikasi Variabel Penelitian	26
1. Variabel Dependen	26
2. Variabel Independen	26
G. Variabel Penelitian dan Pengukuran Variabel	26
1. Variabel Dependen	26
2. Variabel Independen	27
a. <i>Return On Investment</i>	27
b. <i>Earning Per Share</i>	28
c. <i>Price Earning Ratio</i>	28
H. Teknik Analisis Data	29
1. Statistik Deskriptif	29

2.	Analisis Regresi Berganda	30
3.	Uji Asumsi Klasik	30
a.	Uji Multikolinearitas	31
b.	Uji Autokorelasi	32
c.	Uji Heteroskedastisitas	33
I.	Pengujian Hipotesis	34
1.	Uji Model Regresi dan Koefisien dengan Uji F	34
2.	Uji Koefisien Regresi dengan Uji t	37
BAB IV.	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	39
A.	Deskripsi Hasil Penelitian	39
1.	Statistik Deskriptif	39
2.	Hasil Regresi Berganda	42
B.	Hasil Analisis	45
1.	Uji Asumsi Klasik	45
a.	Uji Multikolinearitas	45
b.	Uji Autokorelasi	46
c.	Uji Heteroskedastisitas	47
2.	Uji Hipotesis	48
a.	Uji Model Regresi dan Koefisien dengan Uji F.....	48
b.	Uji Koefisien Regresi dengan Uji t	50
C.	Pembahasan	51

BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	55
A. Kesimpulan	55
B. Saran	56
DAFTAR PUSTAKA	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual	20
--------------------------------------	----

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	19
Tabel 3.1 Kriteria Pengambilan Keputusan Uji <i>Durbin Watson</i> (DW)	32
Tabel 4.1 <i>Descriptive Statistic</i>	39
Tabel 4.2 Hasil Analisis Regresi Berganda	43
Tabel 4.3 Hasil Uji Multikolinearitas	45
Tabel 4.4 Pengambilan Keputusan Ada Tidaknya Autokorelasi	46
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi	47
Tabel 4.6 Hasil Uji Heteroskedastisitas	48
Tabel 4.7 Hasil Uji Model Regresi dan Koefisien dengan Uji F	49
Tabel 4.8 Hasil Koefisien Determinasi	49
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefisien dengan Uji t	50

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Daftar Populasi Perusahaan dalam Penelitian	61
Lampiran 2. Daftar Sampel Perusahaan Yang Mencantumkan Harga Saham	67
Lampiran 3. Daftar Sampel Perusahaan Yang Mencantumkan ROI t_{-1}	73
Lampiran 4. Daftar Sampel Perusahaan Yang Mencantumkan EPS t_{-1}	79
Lampiran 5. Daftar Sampel Perusahaan Yang Mencantumkan PER t_{-1}	85
Lampiran 6. <i>Regresssion</i>	91
Lampuran 7. Uji Multikolinearitas	93
Lampuran 8. Uji Autokorelasi	94
Lampuran 9. Uji Heteroskedastisitas	95
Lampuran 10. Uji Model Regresi dan Koefisien dengan Uji F	96
Lampuran 11. Uji Koefisien Regresi dengan Uji t	97