

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	i
<b>LEMBAR PENGESAHAN</b> .....	iii
<b>PERNYATAAN ORISINALITAS</b> .....	iv
<b>ABSTRAK</b> .....	v
<b>ABSTRACT</b> .....	vi
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	vii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	ix
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	xiii
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xiv
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	xv
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	1
1.1. Latar Belakang Masalah .....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	9
1.3. Manfaat Penelitian.....	9
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN</b>	
<b>HIPOTESIS</b> .....	11
2.1. Kajian Pustaka .....	11
2.1.1.Saham.....	11
2.1.2 Jenis Saham.....	12
2.1.3Harga Saham.....	13
2.1.3.1 Macam-Macam Harga Saham.....	15

2.1.3.2 Penilaian Harga Saham.....	15
2.1.3.3 Faktor-Faktor yang mempengaruhi Harga Saham..	16
2.1.4. <i>Price Earning Ratio</i> .....	17
2.1.5. <i>Return on Equity</i> .....	19
2.1.6. Likuiditas Saham.....	20
2.1.7. <i>Debt to Equity Ratio</i> .....	22
2.2. <i>Review Penelitian Relevan</i> .....	27
2.3. Kerangka Pemikiran .....	31
2.4. Hipotesis .....	34
<b>BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN</b> .....	<b>35</b>
3.1 Tujuan Penelitian.....	35
3.2. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	35
3.2.1. Objek Penelitian .....	35
3.2.2. Periode Penelitian .....	36
3.3. Metode Penelitian .....	36
3.4. Operasionalisasi Variabel Penelitian .....	36
3.4.1. Variabel Dependen .....	36
3.4.2. Variabel Independen.....	37
3.5. Metode Pengumpulan Data .....	38
3.6. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	39
3.6.1 Populasi.....	39
3.6.2 Sampel.....	39

3.7 Metode Analisis.....	39
3.7.1 Model Persamaan Regresi.....	40
3.7.2 Uji Kualitas Data.....	40
3.7.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	41
3.7.2.2.1 Uji Normalitas data.....	41
3.7.2.2.2 Uji Multikolinearitas.....	41
3.7.3 Regresi Panel Data.....	42
3.7.4 Uji Hipotesis.....	44
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>46</b>
4.1. Deskripsi Unit Analisis.....	46
4.2. Hasil Penelitian.....	51
4.2.1. Uji <i>Outlier</i> .....	51
4.2.2. Uji Asumsi Klasik .....	52
4.2.3. Regresi Data Panel.....	54
4.2.4. Persamaan Regresi.....	56
4.2.6. Uji Hipotesis .....	57
4.2.6.1. Uji Parsial (Uji-t).....	57
4.2.6.2. Uji Simultan (Uji-F).....	63
4.2.6.3. Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	64
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>66</b>
5.1. Kesimpulan.....	66
5.2. Saran.....	67

## DAFTAR PUSTAKA

**LAMPIRAN**

**RIWAYAT HIDUP**

## DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
1.1	Harga saham Indeks Kompas100 Tahun 2011-2013.....	5
2.1	Penelitian Relevan.....	30
3.1	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	37
4.1	Statistik Deskriptif .....	46
4.2	Hasil Uji Multikolinieritas .....	54
4.3	Hasil Uji <i>Chow</i> .....	55
4.4	Hasil Uji <i>Hausman</i> .....	56
4.5	Hasil Regresi Data Panel.....	57

## DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
2.1	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	34
4.1	Hasil Uji Normalitas.....	53

## DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama Perusahaan
- Lampiran 2 Sampel Penelitian
- Lampiran 3 Statistik Deskriptif
- Lampiran 4 Uji *Outlier*
- Lampiran 5 Uji Normalitas
- Lampiran 6 Uji Multikolinieritas
- Lampiran 7 Hasil Uji Regresi Data Panel