

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN ORIGINALITAS	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	8
2.1 Kajian Pustaka	8
2.1.1 Pasar Modal	8
2.1.2 Instrumen Pasar Modal	9
2.1.3 Penilaian Saham	13
2.1.4 Harga Saham	14

2.1.5	Analisis Saham	15
2.1.6	Faktor-Faktor yang Pengaruhi Harga Saham	17
2.1.6.1	Faktor Ekonomi Makro	17
2.1.6.2	Faktor Fundamental	21
2.2	<i>Review</i> Penelitian Terdahulu	27
2.3	Kerangka Pemikiran	44
2.4	Hipotesis	48
BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	49
3.1	Obyek dan Ruang Lingkup Penelitian	49
3.1.1	Obyek Penelitian	49
3.1.2	Periode Penelitian	49
3.2	Metode Penelitian	49
3.3	Operasionalisasi Variabel Penelitian	50
3.3.1	Harga Saham	50
3.3.2	<i>Earning Per Share</i> (EPS)	51
3.3.3	<i>Price Earning Per Share</i> (PER)	52
3.3.4	Kebijakan Dividen	52
3.3.5	<i>Firm Size</i> (SIZE)	53
3.3.6	<i>Book Value</i>	54
3.4	Metode Pengumpulan Data	56
3.5	Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	57
3.6	Metode Analisis	57
3.6.1	Analisis Model Regresi Data Panel	58

3.6.2	Uji Model Pendekatan Estimasi Panel	61
3.6.3	Uji <i>Outliers</i>	62
3.6.4	Uji Normalitas	63
3.6.5	Uji Multikolinearitas	63
3.6.6	Uji Heteroskedastisitas	64
3.6.7	Uji Autokorelasi	64
3.6.8	Uji Hipotesis	65
3.6.6.1	Uji t	65
3.6.6.2	Uji F	66
3.6.6.3	Koefisien Determinasi (R^2)	67
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	68
4.1	Deskripsi Unit Analisis	68
4.2	Hasil Uji <i>Outliers</i> dan Uji Asumsi Klasik	72
4.2.1	Uji <i>Outliers</i>	72
4.2.2	Uji Normalitas	72
4.2.3	Uji Multikolinearitas	73
4.2.4	Uji Heteroskedastisitas	74
4.2.5	Uji Autokorelasi	74
4.3	Pembahasan	76
4.3.1	Hasil Uji Model Data Panel	76
4.3.2	Hasil Uji Hipotesis	80
4.3.2.1	Hasil Uji t	80
4.3.2.2	Hasil Uji F	89

4.3.2.3	Koefisien Determinasi (R^2).....	90
4.3.3	<i>Robustness Check</i>	91
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	95
5.1	Kesimpulan	95
5.2	Saran	96

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Matriks <i>Review</i> Penelitian Terdahulu	42
3.1	Operasionalisasi Varibel	55
3.2	Tabel Uji Statistik <i>Durbin-Watson</i>	65
4.1	Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	69
4.2	Korelasi Antarvariabel	73
4.3	Hasil <i>Chow Test</i>	76
4.4	Hasil <i>Hausman Test</i>	78
4.5	Hasil Regresi Data Panel.....	81
4.6	Hasil <i>Robustness Check</i>	92

DAFTAR GAMBAR

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Bagan Ringkasan Kerangka Pemikiran.....	47

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Daftar Emiten yang Menjadi Sampel Penelitian
Lampiran 2	Data Keuangan Perusahaan yang Menjadi Sampel Penelitian
Lampiran 3	Hasil <i>Casewise Diagnostic</i> pada Uji <i>Outliers</i>
Lampiran 4	Histogram <i>Jarque-Bera</i> dan Hasil Uji Regresi OLS
Lampiran 5	Tabel Korelasi Antarvariabel
Lampiran 6	Tabel Hasil Uji Heteroskedastisitas
Lampiran 7	Tabel Hasil Regresi OLS dan Uji Autokorelasi
Lampiran 8	Hasil Uji Model Data Panel
Lampiran 9	Tabel Hasil Uji F
Lampiran 10	Hasil <i>Robustness Check</i>