

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Sampul Depan Skripsi	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Pengesahan Skripsi	iv
Halaman Pengesahan Ujian Skripsi	v
Halaman Motto	vi
Halaman Persembahan	vii
Abstrak	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar Isi	xii
Daftar Tabel	xv
Daftar Gambar	xvi
Daftar Lampiran	xvii
I. Pendahuluan	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	9
1.5 Sistematika Penelitian.....	10

II. KAJIAN PUSTAKA

2.1 Hasil Penelitian Terdahulu	11
2.2 Landasan Teori	12
2.2.1 Pengertian Pasar Modal	12
2.2.2 Manfaat Pasar Modal	18
2.2.3 Efisiensi Pasar Modal	20
2.2.4 Saham Sebagai Instrumen Pasar Modal	22
2.2.5 Saham dan Penggolongannya	23
2.2.6 Proses Penilaian Harga Saham	28
2.2.7 Metode Penilaian Harga Saham	29
2.2.8 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	36
2.2.9 Hubungan Antara <i>Earning per Share</i> , <i>Price to Book Value</i> , dan <i>Return on Investment</i> dengan Harga Saham	39
2.3 Formulasi Hipotesis	41

III. METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian	42
3.2 Populasi dan Sampel	42
3.3 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	43
3.4 Data dan Teknik Pengumpulan Data	44
3.5 Metode Analisis	45
3.5.1 Analisis Regresi Ganda	45
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	46

3.6 Pengujian Hipotesis	51
-------------------------------	----

IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1 Analisis Perubahan Harga Saham dan Faktor-Faktor yang Mempengaruhinya	55
4.1.1 <i>Earning per Share (EPS)</i>	58
4.1.2 <i>Price to Book Value (PBV)</i>	62
4.1.3 <i>Return on Investment (ROI)</i>	63
4.2 Analisis Regresi Linear Ganda	66
4.3 Uji Asumsi Klasik	67
4.4 Pengujian Hipotesis	72

V. SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan.....	80
5.2 Saran.....	83

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
4.1 Perubahan EPS, PBV, dan ROI serta Pengaruhnya terhadap Perubahan Harga Saham	56
4.2 Hasil Analisis Regresi Linier Ganda	66
4.3 Hasil Uji Multikolinieritas	68
4.4 Uji Durbin-Watson	69
4.5 Hasil Uji Autokorelasi	70
4.6 Uji F Hitung	73
4.7 Nilai Koefisien Determinasi (R^2)	74
4.8 Uji T Hitung	75

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Halaman
2.1 Struktur Pasar Modal Indonesia	14
4.1 Scatterplot	71



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Halaman
I Hasil Output SPSS 11.0 For Windows.....	87
II Uji Multikolinieritas.....	90
III Uji Autokorelasi.....	91
IV Uji Heteroskedastisitas.....	92

