

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>PERNYATAAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERSETUJUAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>iv</b>
<b>RIWAYAT HIDUP</b> .....	<b>v</b>
<b>MOTTO</b> .....	<b>vi</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b> .....	<b>vii</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>viii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>ix</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>xii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>xvi</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xvii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xviii</b>

### **BAB I PENDAHULUAN**

1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 RuangLingkupPenelitian.....	6
1.3 Rumusan Masalah .....	6
1.4 Tujuan Masalah .....	7
1.5 Manfaat Penelitian .....	8
1.6 Sistematika Penulisan.....	8

### **BAB II LANDASAN TEORI**

2.1 Teori Sinyal .....	10
2.2 Teori <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH).....	11
2.3 Harga Saham .....	12
2.3.1 Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham.....	13
2.4 Kondisi Fundamental .....	14
2.5 Laporan Keuangan .....	15
2.5.1 Pengertian Rasio Keuangan .....	15
2.5.2 Rasio Profitabilitas .....	15
2.5.2.1 <i>Return On Asset</i> (ROA) .....	16

2.5.3	Rasio Solvabilitas .....	16
2.5.3.1	<i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) .....	16
2.5.4	Rasio Pasar .....	17
2.5.4.1	<i>Earning Per Share</i> (EPS) .....	17
2.5.4.2	<i>Price to Book Value</i> (PBV) .....	17
2.6	Inflasi .....	17
2.7	Suku Bunga SBI.....	18
2.8	Nilai Tukar .....	19
2.9	Penelitian Terdahulu .....	20
2.10	Kerangka Pemikiran.....	22
2.11	Bangunan Hipotesis .....	23
2.11.1	Pengaruh ROA terhadap Harga Saham .....	23
2.11.2	Pengaruh PBV terhadap Harga Saham.....	24
2.11.3	Pengaruh EPS terhadap Harga Saham.....	25
2.11.4	Pengaruh DER terhadap Harga Saham .....	25
2.11.5	Pengaruh Inflasi terhadap Harga Saham .....	26
2.11.6	Pengaruh Suku Bunga SBI terhadap Harga Saham.....	27
2.11.7	Pengaruh Nilai Tukar terhadap Harga Saham.....	27

### **BAB III METODE PENELITIAN**

3.1	Sumber Data.....	29
3.2	Metode Pengumpulan Data .....	29
3.3	Populasi Dan sampel Penelitian .....	29
3.3.1	Populasi .....	29
3.3.2	Sampel.....	30
3.4	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel .....	30
3.4.1.	Variabel Penelitian .....	30
3.4.2.	Definisi Variabel Penelitain .....	31
3.4.2.1	Variabel Dependenden (Y) .....	31
3.4.2.2	Harga Saham .....	31
3.4.2.3	Variabel Independenden (X).....	31

3.4.2.4 ROA .....	31
3.4.2.5 PBV .....	31
3.4.2.6 EPS .....	31
3.4.2.7 DER.....	32
3.4.2.8 Inflasi .....	32
3.4.2.9 Suku Bunga SBI.....	32
3.4.2.10 Nilai Tukar Rupiah.....	32
3.5 Metode Analisis Data .....	33
3.5.1 Statistik Deskriptif .....	33
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	33
3.5.2.1 Uji Normalitas .....	34
3.5.2.2 Uji Multikolinieritas .....	34
3.5.2.3 Uji Autokolerasi .....	35
3.5.2.4 Uji Heterokedastisitas .....	35
3.6 Alat Analisis .....	36
3.6.1 Analisa Regresi Berganda .....	36
3.6.2 Koefisien Determinasi .....	37
3.6.3 Uji F .....	37
3.6.4 Uji T.....	38

## **BAB IV PEMBAHASAN**

4.1 Deskripsi Data .....	39
4.1.1 Deskripsi Objek Penelitian .....	39
4.1.2 Deskripsi Variabel .....	40
4.2 Hasil Analisis Data .....	40
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	40
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	42
4.2.2.1 Uji Normalitas.....	42
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas .....	43
4.2.2.3 Uji Autokorelasi.....	44
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas .....	45

4.3 Hasil Pengujian Hipotesis.....	46
4.3.1 Uji Regresi Linier Berganda.....	46
4.3.2 Uji Koefisien Determinasi .....	48
4.3.3 Uji F.....	49
4.3.4 Uji T.....	50
4.4 Pembahasan .....	52
4.4.1 Pengaruh ROA terhadap Harga Saham .....	52
4.4.2 Pengaruh PBV terhadap Harga Saham .....	53
4.4.3 Pengaruh EPS terhadap Harga Saham.....	54
4.4.4 Pengaruh DER terhadap Harga Saham.....	55
4.4.5 Pengaruh Inflasi terhadap Harga Saham.....	56
4.4.6 Pengaruh Suku Bunga SBI terhadap Harga Saham.....	57
4.4.7 Pengaruh Nilai Tukar terhadap Harga Saham .....	58

## **BAB V SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan.....	59
5.2 Keterbatasan .....	60
5.3 Saran.....	60

## **DAFTAR PUSTAKA**

## **LAMPIRAN**

## DAFTAR TABEL

<b>Isi</b>	<b>Halaman</b>
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	20
Tabel 4.1 Kriteria Pemilihan Sampel .....	39
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif .....	41
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas .....	43
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas .....	44
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi .....	45
Tabel 4.6 Hasil Uji Heterokedastisitas .....	46
Tabel 4.7 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda .....	47
Tabel 4.8 Hasil Uji Koefisien Determinasi .....	49
Tabel 4.9 Hasil Uji F .....	49
Tabel 4.10 Hasil Uji t .....	50
Tabel 4.11 Hasil Penelitian .....	52

## DAFTAR GAMBAR

<b>Isi</b>	<b>Halaman</b>
Gambar 1.1 .....	2
Gambar 2.1 .....	23

## **DAFTAR LAMPIRAN**

Lampiran I

Lampiran 1.1 Statistik Deskriptif

Lampiran 1.2 Uji Normalitas

Lampiran 1.3 Uji Multikolinieritas

Lampiran 1.4 Uji Autokolerasi

Lampiran 1.5 Uji Heterokedastisitas

Lampiran 1.6 Analisis Regresi Linear Berganda

Lampiran 1.7 Koefisien Determinasi

Lampiran 1.8 Uji F

Lampiran 1.9 Uji T

Lampiran 1.10 Tabel Tabulasi Data