

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2 Identifikasi Masalah dan Rumusan Masalah	12
1.2.1 Identifikasi Masalah	12
1.2.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian.....	15
1.3.1 Tujuan Penelitian	15
1.3.2 Kegunaan Penelitian	15
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	17
2.1 Kajian Pustaka	17
2.1.1 Kinerja Keuangan	17
2.1.1.1 Komponen Kinerja Keuangan	18
2.1.1.2 Profitabilitas.....	20
2.1.1.2.1 <i>Earning Per Share</i> (EPS)	22
2.1.1.2.2 Unsur-unsur Pembentukan <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	22
2.1.1.3 Nilai Pasar.....	23

2.1.1.3.1 <i>Price to Book Value</i> (PBV)	24
2.1.1.3.2 Unsur-unsur Pembentukan <i>Price to Book Value</i> (PBV).....	25
2.1.2 Saham	26
2.1.2.1 Jenis-jenis Saham	27
2.1.2.2 Harga Saham.....	30
2.1.2.3 Faktor-faktor yang mempengaruhi harga saham	31
2.1.2.4 <i>Signaling Theory</i>	33
2.1.2.5 Analisis terhadap Harga Saham.....	33
2.1.3 <i>Return</i> Saham	36
2.1.4 Pengaruh Profitabilitas terhadap <i>Return</i> Saham	38
2.1.5 Pengaruh Nilai Pasar terhadap <i>Return</i> Saham.....	39
2.1.2 Penelitian Terdahulu.....	40
2.3 Kerangka Pemikiran	41
2.4 Paradigma Penelitian	45
2.5 Hipotesis	45
BAB III METODE DAN OBJEK PENELITIAN.....	47
3.1 Objek Penelitian	47
3.2 Metode dan Desain Penelitian	47
3.2.1 Metode Penelitian	47
3.2.2 Desain Penelitian	48
3.3 Operasionalisasi Variabel.....	49
3.4 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	51
3.4.1 Sumber Data	51
3.4.2 Teknik Pengumpulan Data	52
3.5 Populasi dan Sampel.....	52

3.5.1 Populasi	52
3.5.2 Sampel	52
3.6 Rancangan Analisis Data dan Uji Hipotesis.....	54
3.6.1 Pengolahan dan Analisis Data	54
3.6.2 Analisis Statistik.....	55
3.6.2.1 Uji Asumsi Klasik	55
3.6.2.2 Analisis Regresi Linier Berganda.....	57
3.6.2.3 Analisis Koefisien Determinasi	58
3.6.3 Uji Hipotesis	59
3.6.3.1 Uji F.....	59
3.6.3.2 Uji t.....	60
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	61
4.1 Hasil Penelitian.....	61
4.1.1 Gambaran Umum Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia.....	61
4.1.2 Deskripsi Data Variabel.....	65
4.1.2.1 Deskripsi Profitabilitas Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	65
4.1.2.2 Deskripsi Nilai Pasar Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	70
4.1.2.3 Deskripsi <i>Return</i> Saham Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	73
4.1.3 Analisis Statistik.....	77
4.1.3.1 Uji Asumsi Klasik	77
4.1.3.2 Analisis Regresi Linier Berganda.....	81

4.1.3.3 Analisis Koefesien Determinasi	82
4.1.3.5 Uji Hipotesis	83
4.1.3.5.1 Uji F	83
4.1.3.5.2 Uji t	84
4.2 Pembahasan	85
4.2.1 Gambaran Profitabilitas Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	85
4.2.2 Gambaran Nilai Pasar Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	87
4.2.3 Gambaran <i>Return</i> Saham Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	89
4.2.4 Pengaruh Profitabilitas dan Nilai Pasar Terhadap <i>Return</i> Saham Perusahaan Pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia	90
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	94
5.1 Kesimpulan	94
5.2 Saran	95
DAFTAR PUSTAKA	96
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Pergerakan <i>Return</i> Saham Sektor Pertambangan Periode 2007-2012	4
Tabel 1.2	Perkembangan <i>Return</i> Saham Subsektor Logam dan Mineral pada Periode 2007-2012.....	6
Tabel 1.3	Rata-rata Kinerja Keuangan Subsektor Logam dan Mineral Periode 2007-2012	8
Tabel 3.1	Operasionalisasi Variabel Penelitian	50
Tabel 3.2	Sampel Penelitian.....	54
Tabel 3.3	Pedoman Untuk Memberikan Interpretasi Koefisien Korelasi	58
Tabel 4.1	Perkembangan <i>Earning Per Share</i> Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012 (dalam Rp)	67
Tabel 4.2	Perkembangan <i>Price to Book Value</i> Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012 (dalam x).....	71
Tabel 4.3	Perkembangan <i>Return</i> Saham Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012 (dalam %)	74
Tabel 4.4	Uji Multikolonieritas.....	78
Tabel 4.5	Uji Autokorelasi.....	79
Tabel 4.6	Analisis Regresi	81

Tabel 4.7 Koefesien Determinasi.....	82
Tabel 4.8 Uji F	83
Tabel 4.9 Uji t.....	84

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Perbandingan Pergerakan <i>Return</i> Saham Sektor Tambang Periode 2007-2012	5
Gambar 1.2 <i>Earning Per Share</i> Subsektor Logam dan Mineral Periode 2007-2012	10
Gambar 1.3 <i>Price to Book Value</i> Subsektor Logam dan Mineral Periode 2007-2012	11
Gambar 2.1 Pengaruh Profitabilitas dan Nilai Pasar terhadap <i>Return</i> Saham Pada Perusahaan Subsektor Logam dan Mineral	44
Gambar 2.2 Paradigma Penelitian.....	45
Gambar 4.1 Perkembangan Rata-rata <i>Earning per Share</i> Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012.	69
Gambar 4.2 Perkembangan Rata-rata <i>Price to Book Value</i> Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012	73
Gambar 4.3 Perkembangan Rata-rata <i>Return</i> Saham Perusahaan pada Subsektor Logam dan Mineral yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2012	76
Gambar 4.4 Uji Normalitas	77
Gambar 4.5 Uji Heteroskedastisitas	80