

DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK.....	i
ABSTRACT.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
UCAPAN TERIMA KASIH.....	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Identifikasi Masalah Penelitian	5
C. Rumusan Masalah Penelitian	7
D. Maksud dan Tujuan Penelitian.....	7
E. Manfaat Penelitian	8
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Teori yang Relevan	10
1. Teori Sinyal	10
2. Konsep Pasar Modal.....	11
a. Pengertian Pasar Modal	11
b. Fungsi Pasar Modal	12
c. Jenis-Jenis Pasar Modal	13
3. Konsep Saham.....	13
a. Pengertian Saham	13
b. Harga Saham.....	14
c. Jenis – Jenis Saham.....	15
d. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	16
e. Penilaian Harga Saham.....	17
d. Keuntungan dan Resiko Saham	18

4.	Konsep Dividen	20
a.	Pengertian Dividen	20
b.	Prosedur Pembayaran Dividen.....	20
c.	Jenis-Jenis Dividen	21
5.	Konsep Laporan Keuangan	22
a.	Pengertian Laporan Keuangan.....	22
b.	Tujuan Laporan Keuangan.....	22
c.	Penggolongan Analisis Rasio Keuangan	23
d.	Rasio Pasar.....	24
e.	<i>Earning Per Share</i> (EPS).....	25
f.	<i>Dividend Per Share</i> (DPS).....	26
6.	Pengaruh Rasio Pasar (<i>Earning Per Share</i> dan <i>Dividend Per Share</i>) Terhadap Harga Saham.....	27
a.	Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap Harga Saham	27
b.	Pengaruh <i>Dividend Per Share</i> Terhadap Harga Saham.....	28
B.	Hasil Penelitian Terdahulu.....	29
C.	Kerangka Pemikiran.....	32
D.	Hipotesis Penelitian.....	35
BAB III METODE PENELITIAN		
A.	Desain Penelitian.....	36
B.	Operasionalisasi Variabel.....	37
C.	Populasi dan Sampel Penelitian	38
D.	Teknik Pengumpulan Data	40
E.	Teknik Pengolahan Data dan Pengujian Hipotesis	41
1.	Teknik Pengolahan Data	41
2.	Pengujian Hipotesis.....	42
a.	Penentuan model Common Effect, Fixed Effect atau Random Effect dalam Mengestimasi Regresi Multipel Menggunakan EViews.....	42
b.	Uji Asumsi Klasik.....	43
c.	Analisis Regresi Multipel	49
d.	Uji Keberartian Koefisien Regresi (Uji F).....	49
e.	Uji Keberartian Koefisien Regresi (Uji t).....	50

BAB IV PEMBAHASAN	
A. Gambaran Objek Penelitian	52
1. Bursa Efek Indonesia.....	52
2. Perusahaan Industri Manufaktur di Indonesia.....	53
3. Profil Perusahaan Manufaktur yang Menjadi Sampel Penelitian.....	55
B. Deskripsi Hasil Penelitian.....	58
1. Rasio Pasar	59
a. <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	59
b. <i>Dividend Per Share</i> (DPS).....	66
2. Harga Saham	70
C. Analisis Data dan Pengujian Hipotesis Penelitian	75
1. <i>Chow Test (Likelihood Ratio)</i>	75
2. <i>Hausman Test</i>	76
3. Uji Asumsi Klasik	77
a. Uji Normalitas.....	77
b. Uji Linearitas	79
c. Uji Autokorelasi.....	80
d. Uji Multikolinearitas.....	82
e. Uji Heteroskedastisitas	82
4. Pengujian Hipotesis	83
a. Analisis Regresi Multipel	83
b. Uji Keberartian Regresi (Uji F)	85
c. Uji Keberartian Koefisien Regresi (Uji t).....	86
D. Pembahasan Hasil Penelitian	88
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
A. Simpulan	92
B. Saran.....	93
DAFTAR PUSTAKA	94
LAMPIRAN.....	

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Data Pertumbuhan Harga Saham Sektoral	2
Tabel 1.2 Nilai Perusahaan Manufaktur Tahun 2011-2014	4
Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel.....	38
Tabel 3.2 Daftar Sampel Penelitian.....	39
Tabel 4.1 Profil Perusahaan Manufaktur Industri Dasar dan Kimia	55
Tabel 4.2 Profil Perusahaan Manufaktur Industri Barang Konsumsi	57
Tabel 4.3 Profil Perusahaan Manufaktur Aneka Industri.....	58
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	58
Tabel 4.5 Earning Per Share Perusahaan Manufaktur Tahun 2011-2014	60
Tabel 4.6 Dividend Per Share Perusahaan Manufaktur Tahun 2011-2014.....	66
Tabel 4.7 Harga Saham Perusahaan Manufaktur Tahun 2011-2014.....	70
Tabel 4.8 Hasil Uji Chow Test.....	76
Tabel 4.9 Hasil Uji Hausman Test	77
Tabel 4.10 Hasil Durbin Watson untuk Uji Linearitas.....	80
Tabel 4.11 Hasil Durbin Watson untuk Uji Autokorelasi	81
Tabel 4.12 Hasil Uji Multikolinearitas dengan Korelasi.....	82
Tabel 4.13 Hasil Perhitungan Regresi Linier Multipel	84
Tabel 4.14 Keputusan Pengujian Uji t.....	88

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1	Grafik Pertumbuhan Harga Saham Sektoral Tahun 2011-2014.....3
Gambar 2.1	Hubungan Antar Variabel.....34
Gambar 4.1	Grafik Perkembangan Rata-Rata EPS Perusahaan Manufaktur62
Gambar 4.2	Rata-Rata EPS Setiap Perusahaan Manufaktur65
Gambar 4.3	Grafik Perkembangan Rata-Rata DPS Perusahaan Manufaktur68
Gambar 4.4	Rata-Rata DPS Setiap Perusahaan Manufaktur.....70
Gambar 4.5	Grafik Perkembangan Rata-Rata Harga Saham Manufaktur72
Gambar 4.6	Rata-Rata Harga Saham Setiap Perusahaan Manufaktur74
Gambar 4.7	Hasil Uji Normalitas.....78
Gambar 4.8	Hasil Uji Normalitas Setelah Transformasi Data79
Gambar 4.9	Grafik Scatter Plot83