

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRAC	ii
KATA PENGANTARiii
UCAPAN TERIMA KASIH.....	.iv
DAFTAR ISIvi
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GRAFIK.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Originalitas Penelitian.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	
2.1 Kajian Teoritis.....	10
2.1.1 Pengertian dan Instrumen Pasar Modal.....	11
2.1.2 Return Harapan dan Risiko Portofolio.....	12
A. Investasi.....	12
B. Risiko dan Pengembalian (<i>Risk and Return</i>).....	13
2.1.3 Model-model Keseimbangan	14

A. Capital Asset Pricing Model	14
B. Pricing Theory Arbitrage	14
2.1.4 Analisis Penilaian Harga Saham	15
2.1.5 Faktor-faktor Fundamental	18
2.1.6 Obligasi	21
2.1.7 Penilaian Obligasi	22
A. Penilaian Obligasi	22
B. Tingkat Bunga Obligasi.....	23
2.1.8 Sekuritas Derivatif	24
A. Opsi	24
B. Bukti (Right), Waran (Warrant), dan Obligasi Konversi (Convertible Bonds).....	24
2.1.9 Futures.....	27
2.1.10 Pemilihan Portofolio	28
2.1.11 Pengertian Saham.....	31
2.1.12 Jenis-jenis Saham.....	31
A. Saham Biasa	31
B. Saham Preferen.....	32
2.1.3 Keuntungan Pembelian Saham	34
2.1.4 Resiko Kepemilikan Saham	34
2.1.5 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	35
2.1.6 Pengertian Dividen.....	36
2.1.7 Jenis-jenis Dividen.....	37

2.1.8 Kebijakan Dividen	38
2.1.9 Earning per Share (EPS)	44
2.2 Tinjauan Penelitian Terdahulu	46
2.3 Kerangka Pemikiran.....	49
2.4 Hipotesis.....	51

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Metode Penelitian.....	52
3.2 Objek Penelitian	52
3.3 Operasionalisasi Variabel	53
3.4 Populasi dan Sampel	54
3.5 Jenis dan Sumber Data	56
3.6 Teknik dan Pengumpulan Data	57
3.7 Teknik Analisis Data.....	57
3.7.1 Analisis Statistik	57
3.7.2 Uji Asumsi Klasik.....	58
3.7.2.1 Uji Normalitas.....	58
3.7.2.2 Uji Multikolinearitas.....	58
3.7.2.3 Uji Heteroskedasitas.....	58
3.7.2.4 Uji Autokorelasi.....	59
3.7.3 Uji Hipotesis	59
3.7.4 Koefisien Determinasi.....	61

BAB IV ANALISIS HASIL PENELITIAN

4.1 Deskripsi Data Statistik.....	62
-----------------------------------	----

4.1.1 Harga Saham pada Perusahaan Manufaktur	62
4.1.2 DPS pada Perusahaan Manufaktur.....	63
4.1.3 EPS pada Perusahaan Manufaktur	64
4.2 Uji Asumsi Klasik	65
4.2.1 Uji Normalitas.....	65
4.2.2 Uji Multikolinearitas.....	70
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas.....	71
4.2.4 Uji Autokorelasi	72
4.3 Pengujian Hipotesis.....	72
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian	76
4.4.1 Analisa Hubungan DPS dengan Harga Saham	76
4.4.2 Analisa Hubungan EPS dengan Harga Saham.....	77
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	80
5.2 Saran.....	81
DAFTAR PUSTAKA	83
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	