

DAFTAR ISI

| | |
|--|------------|
| ABSTRAK | i |
| ABSTRACT | ii |
| KATA PENGANTAR..... | iii |
| DAFTAR ISI..... | vii |
| DAFTAR TABEL | x |
| DAFTAR GAMBAR..... | xi |
| DAFTAR LAMPIRAN | xii |
| | |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang masalah | 1 |
| 1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah | 12 |
| 1.2.1 Identifikasi Masalah..... | 12 |
| 1.2.1 Rumusan Masalah..... | 13 |
| 1.3 Tujuan Penelitian | 14 |
| 1.4 Kegunaan Penelitian | 14 |
| 1.2.1 Kegunaan teoritis | 14 |
| 1.2.1 Kegunaan Praktis | 15 |
| | |
| BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS.16 | |
| 2.1 Kajian Pustaka | 16 |
| 2.1.1 Kinerja Keuangan | 16 |
| 2.1.2 Rasio Profitabilitas..... | 20 |
| 2.1.3 Pasar Modal | 28 |
| 2.1.3.1 Pengertian Pasar Modal..... | 28 |
| 2.1.3.2 Peranan Pasar Modal..... | 29 |
| 2.1.3.3 Instrumen Pasar Modal | 30 |
| 2.1.4 Saham..... | 32 |
| 2.1.4.1 Definisi Saham..... | 32 |

| | |
|---|-----------|
| 2.1.4.2 Jenis Saham..... | 33 |
| 2.1.5 Harga Saham..... | 36 |
| 2.1.5.1 Pengertian Harga Saham..... | 36 |
| 2.1.5.2 Faktor-Faktor Yang mempengaruhi Harga Saham | 38 |
| 2.1.5.3 Nilai Saham..... | 39 |
| 2.1.5.3 Analisis Harga Saham..... | 40 |
| 2.1.6 Pengaruh Profitabilitas Terhadap Harga Saham..... | 42 |
| 2.1.7 Penelitian Terdahulu..... | 43 |
| 2.2 Kerangka Pemikiran..... | 45 |
| 2.3 Hipotesis | 48 |
| BAB III METODE PENELITIAN | 49 |
| 3.1 Objek Penelitian..... | 49 |
| 3.2 Metode Penelitian dan Desain Penelitian | 50 |
| 3.2.1 Metode Penelitian | 50 |
| 3.2.2 Desain Penelitian | 51 |
| 3.3 Operasionalisasi Variabel | 52 |
| 3.4 Jenis, Sumber dan Teknik Pengumpulan Data | 53 |
| 3.4.1 Jenis dan Sumber Data..... | 53 |
| 3.4.2 Teknik Pengumpulan Data..... | 53 |
| 3.5 Populasi, Sampel dan Teknik Penarikan Sampel..... | 54 |
| 3.6 Rancangan Analisis Data dan Uji Hipotesis | 56 |
| 3.6.1 Rancangan Analisis Data | 56 |
| 3.6.1.1 Analisis Deskriptif..... | 57 |
| 3.6.1.2 Analisis Statistik..... | 58 |
| 3.6.2 Uji Hipotesis | 61 |
| BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... | 64 |
| 4.1 Hasil Penelitian | 64 |
| 4.1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian | 64 |
| 4.1.2 Deskripsi Data variabel Penelitian..... | 74 |

| | |
|--|------------|
| 4.1.2.1 Gambaran Profitabilitas (EPS) Perusahaan Subsektor Transportasi | 75 |
| 4.1.2.2 Gambaran Harga Saham Perusahaan Subsektor Transportasi. | 84 |
| 4.1.3 Analisis Data dan Uji Hipotesis..... | 88 |
| 4.1.3.1 Analisis Data | 88 |
| 4.1.3.2 Uji Hipotesis..... | 91 |
| 4.2 Pembahasan..... | 93 |
| 4.2.1 Profitabilitas (EPS) Pada Perusahaan Subsektor Transportasi yang Terdaftar di BEI | 93 |
| 4.2.2 Harga Saham Pada Perusahaan Subsektor Transportasi yang Terdaftar di BEI..... | 96 |
| 4.2.2 Pengaruh Profitabilitas Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Subsektor Transportasi yang Terdaftar di BEI | 97 |
| BAB V KESIMPULAN DAN SARAN | 100 |
| 5.1 Kesimpulan | 100 |
| 5.2 Saran | 102 |
| DAFTAR PUSTAKA | 104 |
| LAMPIRAN | |

DAFTAR TABEL

| | |
|---|----|
| Tabel 1.1 Perkembangan Angka Indeks harga Saham Sektoral Periode 2008-2010 (dalam rupiah) | 4 |
| Tabel 1.2 Nilai Kapitalisasi Pasar Sektor Infrastruktur di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010 (dalam jutaan rupiah) | 6 |
| Tabel 1.3 Harga Saham dan Rata-Rata harga Saham Subsektor transportasi di BEI Periode 2006-2010 | 7 |
| Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel | 52 |
| Tabel 3.2 Jenis dan Sumber Data | 53 |
| Tabel 3.3 Daftar Sampel Perusahaan | 56 |
| Tabel 3.4 Nilai Koefisien Korelasi | 60 |
| Tabel 4.1 Perkembangan Profitabilitas (EPS) Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010) | 80 |
| Tabel 4.2 Perkembangan Harga Saham Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010) | 85 |
| Tabel 4.3 Daftar Ringkasan Perhitungan Regresi | 89 |
| Tabel 4.4 Hasil Uji Korelasi | 90 |
| Tabel 4.5 Hasil Uji Koefisien Determinasi | 91 |

DAFTAR GAMBAR

| | | |
|------------|---|----|
| Gambar 1.1 | Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia Tahun 1997-2010 | 3 |
| Gambar 1.2 | Grafik Rata-Rata EPS Subsektor Transportasi periode 2006-2010 | 11 |
| Gambar 2.1 | Paradigma Penelitian Pengaruh Profitabilitas Terhadap Harga Saham Pada Subsektor Transportasi di Bursa Efek Indonesia | 48 |
| Gambar 4.1 | Grafik Perkembangan Jumlah Laba Bersih Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010) | 78 |
| Gambar 4.2 | Grafik Perkembangan Jumlah Saham Yang Beredar Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010) | 78 |
| Gambar 4.3 | Grafik Perkembangan Profitabilitas EPS Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010) | 83 |
| Gambar 4.4 | Perkembangan Harga Saham Perusahaan Subsektor Transportasi di BEI (2006-2010)..... | 88 |

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama Perusahaan Yang Menjadi Populasi Penelitian
- Lampiran 2 *Financial Data & Ratio* Perusahaan Penelitian
- Lampiran 3 Tabel Perhitungan Profitabilitas (EPS) Perusahaan Subsektor
Transportasi Periode 2006-2010
- Lampiran 4 Hasil Output SPSS
- Lampiran 5 Perhitungan Manual Regresi Linier Sederhana
- Lampiran 6 Harga Saham Perusahaan Subsektor Transportasi Periode 2006-2010
- Lampiran 7 Catatan Bimbingan
- Lampiran 8 SK Pembimbing
- Lampiran 9 Daftar Riwayat Hidup