DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN .....

LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN .....

MOTTO .....

***ABSTRACT* ..... i**

ABSTRAK ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR GAMBAR x

DAFTAR TABEL xi

DAFTAR LAMPIRAN xii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 9

1.2.1 Identifikasi Masalah 9

1.2.2 Rumusan Masalah 11

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 11

1.3.1 Maksud Penelitian 11

1.3.2 Tujuan Penelitian 12

1.4 Kegunaan Penelitian 13

1.4.1 Kegunaan Praktis 13

1.4.2 Kegunaan Akademis 13

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian 13
1.5.1 Lokasi Penelitian 13
1.5.2 Waktu Penelitian 14
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS
2.1 Kajian Pustaka 15
2.1.1 Profitabilitas 15
2.1.1.1 Pengertian Profitabilitas 15
2.1.1.2 Jenis-jenis Rasio Profitabilitas 16
2.1.1.3 *Return on equity* (ROE) 16
2.1.2 Dividen 17
2.1.2.1 Pengertian Dividen 17
2.1.2.2 Jenis-jenis Dividen 18
2.1.2.3 Kebijakan Dividen 20
2.1.2.4 Teori Kebijakan Dividen 21
2.1.2.5 *Dividend per share* (DPS)..... 23
2.1.3 Saham 25
2.1.3.1 Pengertian Saham 25
2.1.3.2 Jenis-jenis Saham 25
2.1.3.3 Nilai Saham 28
2.1.3.4 Harga Saham 29
2.1.3.5 Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham 30
2.1.4 Penelitian Terdahulu 31

2.2 Kerangka Pemikiran 33
2.2.1 Pengaruh *Return on equity* Terhadap Harga Saham 36
2.2.2 Pengaruh *Dividend per share* Terhadap Harga Saham 37
2.3 Hipotesis Penelitian 38

BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian 39
3.2 Metode Penelitian 39
3.2.1 Desain Penelitian 41
3.2.2 Operasionalisasi Variabel 44
3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data 47
3.2.3.1 Sumber Data 47
3.2.3.2 Teknik Penentuan Data 47
3.2.4 Teknik Pengumpulan Data 51
3.2.5 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis 52
3.2.5.1 Rancangan Analisis 52
3.2.5.1.1 Analisis Regresi Linier Berganda 58
3.2.5.2 Pengujian Hipotesis 61

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Bursa Efek Indonesia 67
4.1.1 Gambaran Umum Bursa Efek Indonesia 67
4.1.2 Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia 69
4.1.3 Uraian Tugas (*Job Description*) 71
4.1.4 Aktivitas Bursa Efek Indonesia 83

4.2 Analisis Deskriptif 83
4.2.1 Analisis Deskriptif *Return on equity* Pada Perusahaan Pertambangan Tahun 2005-2010 83
4.2.2 Analisis Deskriptif *Dividend per share* Pada Perusahaan Pertambangan Tahun 2005-2010 88
4.2.3 Analisis Deskriptif Harga Saham Pada Perusahaan Pertambangan Tahun 2006-2011 92
4.3 Analisis Verifikatif 96
4.3.1 Pengujian Asumsi Klasik 97
4.3.2 Analisis Regresi Linier Berganda 102
4.3.3 Pengaruh *Return on equity* Terhadap Harga Saham Secara Parsial 103
4.3.4 Pengaruh *Dividend per share* Terhadap Harga Saham Secara Parsial 108
4.3.5 Pengaruh *Return on equity* dan *Dividend per share* Terhadap Harga Saham Secara Simultan 113

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan 119
5.2 Saran 121

DAFTAR PUSTAKA 123

LAMPIRAN-LAMPIRAN 127

DAFTAR GAMBAR

Halaman

Gambar 2.1 Skema Kerangka Pemikiran 35

Gambar 3.1 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis 67

Gambar 4.1 Grafik Perkembangan ROE Pada Perusahaan Pertambangan tahun 2005-2010 87

Gambar 4.2 Grafik Perkembangan DPS Pada Perusahaan Pertambangan tahun 2005-2010 91

Gambar 4.3 Grafik Perkembangan Harga Saham Pada Perusahaan Pertambangan tahun 2005-2010 95

Gambar 4.4 Grafik Normalitas 98

Gambar 4.5 Hasil Pengujian Asumsi Heteroskedastisitas 100

Gambar 4.6 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Pada Pengujian Hipotesis Pengaruh ROE Terhadap Harga Saham Secara Parsial (Uji t) 106

Gambar 4.7 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Pada Pengujian Hipotesis Pengaruh DPS Terhadap Harga Saham Secara Parsial (Uji t) 111

Gambar 4.8 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Pada Pengujian Hipotesis Secara Simultan (Uji Statistik F) 117

DAFTAR TABEL

Halaman

Tabel 1.1 Data Harga Saham dan *Return on equity* Perusahaan Pertambangan tahun 2006-2010 7

Tabel 1.2 Jadwal Penelitian 14

Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Sebelumnya 31

Tabel 3.1 Desain Penelitian 44

Tabel 3.2 Operasionalisasi Variabel 46

Tabel 3.3 Populasi Penelitian 48

Tabel 3.4 Kriteria Penentuan Pengambilan Sampel 50

Tabel 3.5 Daftar Perusahaan yang menjadi Sampel Penelitian 51

Tabel 3.6 Pedoman untuk memberikan Interpretasi Koefisien Korelasi 61

Tabel 4.1 Perkembangan ROE Pada Perusahaan Pertambangan 84

Tabel 4.2 Perkembangan DPS Pada Perusahaan Pertambangan 88

Tabel 4.3 Perkembangan Harga Saham Pada Perusahaan Pertambangan 93

Tabel 4.4 Hasil Pengujian Asumsi Normalitas 98

Tabel 4.5 Hasil Pengujian Asumsi Multikoliniearitas 99

Tabel 4.6 Hasil Pengujian Asumsi Autokorelasi Nilai Durbin-Watson 101

Tabel 4.7 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda 102

Tabel 4.8 Koefisien Korelasi ROE Dengan Harga Saham 103

Tabel 4.9 Koefisien Korelasi DPS dengan Harga Saham 108

Tabel 4.10 Analisis Koefisien Korelasi Berganda dan Koefisien Determinasi 114

Tabel 4.11 Anova Untuk Uji Simultan (Uji F) 116

DAFTAR LAMPIRAN

Halaman

Lampiran 1	Permohonan Mengadakan Penelitian/Pengumpulan Data	128
Lampiran 2	Surat Keterangan Telah Melakukan Riset di BEI	129
Lampiran 3	Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia	130
Lampiran 4	Hasil Output SPSS	131
Lampiran 5	Tabel Distribusi t	136
Lampiran 6	Tabel Distribusi F	137
Lampiran 7	Tabel Durbin Watson	138
Lampiran 8	Harga Saham Perusahaan Pertambangan Tahun 2006-2011	139
Lampiran 9	Laporan Keuangan PT Aneka Tambang (Persero) Tbk	141
Lampiran 10	Laporan Keuangan PT Bumi Resources Tbk	149
Lampiran 11	Laporan Keuangan PT International Nickel Indonesia Tbk	158
Lampiran 12	Laporan Keuangan PT Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk	167
Lampiran 13	Laporan Keuangan PT Timah (Persero) Tbk	178
Lampiran 14	Catatan Khusus Kegiatan Bimbingan dan Konsultasi	187
Lampiran 15	Lembar Revisi Sidang	188