DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN

SURAT PERNYATAAN

MOTTO

ABSTRACT..... i

ABSTRAK..... ii

KATA PENGANTAR……. iii

DAFTAR ISI……. vi

DAFTAR GAMBAR..... x

DAFTAR TABEL…… xi

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian……..…….. 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah…… 7

1.2.1 Identifikasi Masalah……... 7

1.2.2 Rumusan Masalah…….. 8

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian…… 9

1.4 Kegunaan Penelitian……..……... 10

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian……..... 11

1.5.1 Lokasi Penelitian…….. 11

1.5.2 Waktu Penelitian……... 11

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 KajianPustaka…….. 13

2.1.1 *Earning Per Share* (EPS)……..... 13

2.1.2 *Return On Asset* (ROA)……....… 15

2.1.3 Harga Saham…….…. 16

2.1.3.1 Jenis-jenis Nilai Saham…….. 17

2.1.3.2 Faktor-faktor Pembentuk Harga Saham…… 17

2.2 KerangkaPemikiran ……..... 18

2.2.1 Hubungan *Earning Per Share* (EPS) dengan

Harga Saham..... 19

2.2.2 Hubungan *Return On Asset* (ROA) dengan

Harga Saham..... 21

2.2.3 Penelitian Terdahulu..... 22

2.3 Hipotesis……. 27

BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian…… 28

3.2 Metode Penelitian……. 28

3.2.1 Desain Penelitian…….…. 30

3.2.2 Operasional Variabel……..... 31

3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data…… 33

3.2.3.1 Sumber Data……. 33

3.2.3.2 Teknik Penentuan Data……..... 33

3.2.4 Teknik Pengumpulan Data…….. 36

3.2.4.1 Hasil Pengujian Normalitas……...…….. 37

3.2.4.2 Hasil Pengujian Multikolineritas……...….. 38

3.2.4.3 Hasil Pengujian Heterokedastisitas…….…..… 39

3.2.4.4 Hasil Pengujian Autokorelasi…….....…...… 40

3.2.5 Rancangan Analisis dan Uji Hipotesis…..….....… 41

3.2.5.1 Rancangan Analisis……...…….. 41

3.2.5.2 Pengujian Hipotesis…….……...…..… 46

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian……..…… 50

4.1.1 Gambaran Umum Bursa Efek Indonesia……...…. 50

4.1.2 Struktur Bursa Efek Indonesia…….....……. 51

4.1.3 Uraian Tugas Bursa Efek Indonesia…….....…. 53

4.1.4 Aspek Kegiatan Bursa Efek Indonesia……...…. 64

4.2 Analisis Deskriptif…….....…….....… 65

4.2.1 Analisis *Earning Per Share* (EPS)…….....….... 65

4.2.2 Analisis *Return On Asset* (ROA)……..... 69

4.2.3 Analisis Harga Saham.....……..... 73

4.3 Analisis Verifikatif.....……...……..... 77

4.3.1 Pengaruh EPS terhadap Harga Saham secara

Parsial..... 79

4.3.2 Pengaruh ROA terhadap Harga Saham secara

Parsial..... 85

4.3.3 Pengaruh EPS dan ROA terhadap Harga Saham

secara Simultan..... 93

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan .....…….……..….. 96

5.2 Saran…….....…..… 98

DAFTAR PUSTAKA……..... **99**

LAMPIRAN LAIN..... **100**

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran..... 25

Gambar 2.2 Paradigma Penelitian..... 26

Gambar 3.1 Grafik Normal P-Plot..... 38

Gambar 3.2 Grafik Uji Heterokedastisitas..... 40

Gambar 3.3 Daerah Pengujian Autokorelasi dengan Uji Durbin..... 41

Gambar 3.4 Uji Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis..... 49

Gambar 4.1 Grafik Data EPS..... 57

Gambar 4.2 Grafik Data ROA..... 70

Gambar 4.3 Grafik Data Harga Saham..... 74

Gambar 4.4 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X1 terhadap Y..... 83

Gambar 4.5 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X2 terhadap Y..... 90

Gambar 4.6 Daerah Penerimaan dan Penolakan Ho..... 95

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Data *Earning Per Share* (EPS) dan Harga Saham..... 5

Tabel 1.2 Jadwal Penelitian..... 11

Tabel 2.1 Tabel Penelitian Sebelumnya..... 22

Tabel 3.1 Desain Penelitian..... 31

Tabel 3.2 Operasionalisasi Variabel..... 32

Tabel 3.3 Jumlah Populasi Emiten..... 34

Tabel 3.4 Hasil Uji Normalitas..... 37

Tabel 3.5 Hasil Uji Multikolinearitas..... 39

Tabel 3.6 Hasil Uji Heteroskedastisitas..... 39

Tabel 3.7 Kategori Korelasi Metode Guilford..... 37

Tabel 4.1 Data *Earning Per Share* (EPS)..... 66

Tabel 4.2 Data *Return On Asset (ROA*)..... 69

Tabel 4.3 Data Harga Saham..... 73

Tabel 4.4 Hasil Regresi Linier Berganda..... 78

Tabel 4.5 Hasil Korelasi Parsial EPS dengam Harga Saham
apabila ROA Konstan..... 80

Tabel 4.6 Hasil Korelasi Parsial ROA dengam Harga Saham
apabila EPS Konstan..... 86

Tabel 4.7 Hasil Korelasi Simultan..... 91

Tabel 4.8 Hasil ANNOVA Uji F..... 94