DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

PERNYATAAN KEASLIAN

MOTO

ABSTRAK i

ABSTRACT ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR TABEL x

DAFTAR GAMBAR xii

DAFTAR LAMPIRAN xiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 9

1.2.1 Identifikasi Masalah 9

1.2.2 Rumusan Masalah 9

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 10

1.3.1 Maksud Penelitian 10

1.3.2 Tujuan Penelitian 10

1.4 Kegunaan Penelitian 11

1.4.1 Kegunaan Praktis 11

1.4.2 Kegunaan Akademis 11

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian 12

1.5.1 Lokasi Penelitian 12

1.5.2 Waktu Penelitian..... 12

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka..... 14

2.1.1 *Earning Per Share* 14

2.1.1.1 Pengertian *Earning Per Share* 14

2.1.1.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi *Earning Per Share*.. 15

2.1.1.3 Perhitungan *Earning Per Share*..... 15

2.1.2 *Price Earning Ratio*..... 16

2.1.2.1 Pengertian *Price Earning Ratio*..... 16

2.1.2.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi *Price Earning Ratio* 17

2.1.2.3 Perhitungan *Price Earning Ratio* 17

2.1.3 Harga Saham..... 17

2.1.3.1 Pengertian Harga Saham 17

2.1.3.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham 18

2.1.4 Hasil Penelitian Terdahulu 20

2.2 Kerangka Pemikiran..... 22

2.2.1 Keterkaitan *Earning Per Share* terhadap Harga Saham..... 24

2.2.2 Keterkaitan *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham..... 25

2.3 Hipotesis..... 26

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian..... 27

3.2 Metode Penelitian..... 27

3.2.1 Desain Penelitian 30
3.2.2 Operasional Variable 31
3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data 34
3.2.3.1 Sumber Data 34
3.2.3.2 Teknik Penentuan Data 35
3.2.4 Teknik Pengumpulan Data 39
3.2.4.1 Uji Reliabilitas 40
3.2.5 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis 40
3.2.5.1 Rancangan Analisis 40
3.2.5.2 Pengujian Hipotesis 47

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian 52
4.1.1 Gambaran Umum Hasil Penelitian 52
4.1.1.1 Sejarah Singkat Perusahaan 52
4.1.1.2 Struktur Organisasi 54
4.1.1.3 Uraian Tugas 56
4.1.1.4 Aktivitas Bursa Efek Indonesia 67
4.1.2 Analisis Deskriptif 67
4.1.2.1 *Earning Per Share* pada *Jakarta Islamic Index* 67
4.1.2.2 *Price Earning Ratio* pada *Jakarta Islamic Index* 71
4.1.2.3 Harga Saham pada *Jakarta Islamic Index* 74
4.1.3 Analisis Verifikatif 78
4.1.3.1 Uji Asumsi Klasik 78

4.1.3.2 Analisis Regresi Linear Berganda 83
4.1.3.3 Analisis Korelasi..... 88
4.1.3.4 Pengujian Hipotesis 95
4.1.3.5 Penarikan Kesimpulan..... 101
4.2 Pembahasan..... 102
4.2.1 *Earning Per Share, Price Earning Ratio* dan Harga Saham pada *Jakarta Islamic Index* di Bursa Efek Indonesia 102
4.2.1.1 *Earning Per Share* pada *Jakarta Islamic Index*..... 102
4.2.1.2 *Price Earning Ratio* pada *Jakarta Islamic Index* 104
4.2.1.3 Harga Saham pada *Jakarta Islamic Index* 105
4.2.2 Pengaruh *Earning Per Share* dan *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham Secara Parsial dan Simultan..... 106
4.2.2.1 Pengaruh *Earning Per Share* terhadap Harga Saham ... 106
4.2.2.2 Pengaruh *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham . 109
4.2.2.3 Pengaruh *Earning Per Share* dan *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham secara Simultan 112

BAB IV SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan 116
5.2 Saran..... 118

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	EPS, PER dan Harga Saham *Jakarta Islamic Index* di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2012	6
Tabel 1.2	Waktu Penelitian	12
Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu	20
Tabel 3.1	Desain Penelitian	30
Tabel 3.2	Operasional Variabel	33
Tebel 3.3	Daftar Perusahaan yang dijadikan Populasi	36
Tabel 3.4	Daftar Perusahaan yang dijadikan Sampel	38
Tabel 3.5	Interpretasi Koefisien Korelasi	46
Tabel 4.1	*Earning Per Share Jakarta Islamic Index* tahun 2010-2012	68
Tabel 4.2	Data Statistik *Earning Per Share*	69
Tabel 4.3	*Price Earning Ratio Jakarta Islamic Index* tahun 2010-2012	71
Tabel 4.4	Data Statistik *Price Earning Ratio*	72
Tabel 4.5	Harga Saham *Jakarta Islamic Index* tahun 2011-2013	75
Tabel 4.6	Data Statistik Harga Saham	76
Tabel 4.7	Hasil Pengujian Asumsi Normalitas	79
Tabel 4.8	Hasil Pengujian Asumsi Multikolinieritas	80
Tabel 4.9	Hasil Pengujian Asumsi Heteroskedastisitas	81
Tabel 4.10	Hasil Pengujian Asumsi Autokorelasi	82
Tabel 4.11	Hasil Pengujian Asumsi Autokorelasi *Runs Test*	83
Tabel 4.12	Data Untuk Perhitungan Analisis Regresi Berganda	83
Tabel 4.13	Koefisien Korelasi antar Variabel	89

Tabel 4.14 Korelasi Parsial *Earning Per Share* dan Harga Saham..... 90

Tabel 4.15 Korelasi Parsial *Price Earning Ratio* dan Harga Saham 91

Tabel 4.16 Koefisien Korelasi Secara Simultan 93

Tabel 4.17 Koefisien Determinasi Parsial..... 94

Tabel 4.18 Koefisien Determinasi Simultan 95

Tabel 4.19 Pengaruh *Earning Per Share* terhadap Harga Saham..... 97

Tabel 4.20 Pengaruh *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham..... 98

Tabel 4.21 Pengaruh *Earning Per Share* dan *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham secara Simultan 100

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Paradigma Penelitian 26

Gambar 3.1 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis Uji t 50

Gambar 3.2 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis Uji F 51

Gambar 4.1 Grafik *Earning Per Share Jakarta Islamic Index* 70

Gambar 4.2 Grafik Rata-rata *Earning Per Share* tahun 2010-2012 70

Gambar 4.3 Grafik *Price Earning Rario Jakarta Islamic Index* 73

Gambar 4.4 Grafik Rata-rata *Price Earning Ratio* tahun 2010-2012 74

Gambar 4.5 Grafik Harga Saham *Jakarta Islamic Index* 77

Gambar 4.6 Grafik Rata-rata Harga Saham tahun 2011-2013 77

Gambar 4.7 Uji Durbin-Watson 82

Gambar 4.8 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis Hasil Pengujian Pengaruh *Earning Per Share* terhadap Harga Saham 108

Gambar 4.9 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis Hasil Pengujian Pengaruh *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham 111

Gambar 4.10 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis Hasil Pengujian Pengaruh *Earning Per Share* dan *Price Earning Ratio* terhadap Harga Saham Secara Simultan 114

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Surat Permohonan Penelitian

Lampiran 2 Surat Persetujuan Penelitian

Lampiran 3 Berita Acara Bimbingan Skripsi

Lampiran 4 Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia

Lampiran 5 Ikhtisar Keuangan PT Astra Agro Lestari Tbk. [AALI]

Lampiran 6 Ikhtisar Keuangan PT Aneka Tambang (Persero) Tbk. [ANTM]

Lampiran 7 Ikhtisar Keuangan PT Vale Indonesia Tbk. [INCO]

Lampiran 8 Ikhtisar Keuangan PT Indocement Tunggal Perkasa Tbk. [INTP]

Lampiran 9 Ikhtisar Keuangan PT Kalbe Farma Tbk. [KLBF]

Lampiran 10 Ikhtisar Keuangan PT Tambang Batubara Bukit Asam Tbk [PTBA]

Lampiran 11 Ikhtisar Keuangan PT Semen Gresik (Persero) Tbk. [SMGR]

Lampiran 12 Ikhtisar Keuangan PT Timah [TINS]

Lampiran 13 Ikhtisar Keuangan PT Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk. [TLKM]

Lampiran 14 Ikhtisar Keuangan Unilever Indonesia Tbk. [UNVR]

Lampiran 15 Harga Saham Akhir Tahun Yang Digunakan Sebagai Salah Satu Indikator *Price Earning Ratio* Pada Perusahaan Yang Tergabung Dalam *Jakarta Islamic Index* Di Bursa Efek Indonesia

Lampiran 16 Harga Saham (Y) Yang Digunakan Pada Perusahaan Yang Tergabung Dalam *Jakarta Islamic Index* Yang Di Bursa Efek Indonesia