DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN

LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN

MOTTO

ABSTRAK i

ABSTRACT ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR GAMBAR x

DAFTAR TABEL xi

DAFTAR LAMPIRAN xiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 11

1.2.1 Indentifikasi Masalah 11

1.2.2 Rumusan Masalah 12

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 12

1.3.1 Maksud Penelitian 12

1.3.2 Tujuan Penelitian 13

1.4 Kegunaan Penelitian 13

1.4.1 Kegunaan Praktis 13

1.4.2 Kegunaan Akademis 14

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian.....15

1.5.1 Lokasi Penelitian 15

1.5.2 Waktu Penelitian.....15

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka.....17

2.1.1 *Earning Per Share* (EPS).....17

2.1.1.1 Pengertian *Earning Per Share* (EPS).....17

2.1.1.2 Faktor-faktor Penyebab Kenaikan dan Penurunan *Earning Per Share* (EPS).....18

2.1.2 *Return On Equity* (ROE).....19

2.1.2.1 Pengertian *Return On Equity* (ROE) 19

2.1.3 Harga Saham 21

2.1.3.1 Pengertian Harga Saham.....21

2.1.3.2 Faktor – faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....22

2.1.3.3 Jenis-Jenis Harga Saham.....24

2.1.4 Hasil Penelitian Sebelumnya 25

2.2 Kerangka Pemikiran 28

2.2.1 Keterkaitan *Earning per Share* (EPS) Dengan Harga Saham ...31

2.1.2 Keterkaitan *Return On Equity* (ROE) Dengan Harga Saham....32

2.3 Hipotesis.....33

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian 35

3.2 Metode Penelitian.....35

3.2.1 Desain Penelitian 37
3.3 Operasionalisasi Variabel.....39
3.4 Sumber dan Teknik Penentuan Data 42
3.4.1 Sumber Data 42
3.4.2 Teknik Penentuan Data.....43
3.4.3 Teknik Pengumpulan Data 48
3.5 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis 48
3.5.1 Rancangan Analisis 48
3.5.2 Pengujian Hipotesis 57
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN
4.1 Hasil Penelitian 63
4.1.1 Gambaran Umum Bursa Efek Indonesia 63
4.1.1.1 Sejarah Bursa Efek Indonesia 63
4.1.1.2 Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia 65
4.1.1.3 Uraian Tugas Bursa Efek Indonesia 67
4.1.1.4 Aktivitas Bursa Efek Indonesia 78
4.1.2 Analisis Deskriptif 79
4.1.2.1 Analisis Deskriptif *Earning Per Share* (EPS) Pada Perusahaan Sektor Perbankan Tahun 2009-2012 79
4.1.2.2 Analisis Deskriptif *Return On Equity* (ROE) Pada Perusahaan Sektor Perbankan Tahun 2009-2012 83
4.1.2.3 Analisis Deskriptif Harga Saham Pada Perusahaan Sektor Perbankan Tahun 2010-2013 87

4.1.3 Analisis Verifikatif 90
4.1.3.1 Pengujian Asumsi Klasik.....90
4.1.3.2 Analisis Regresi Linier Berganda 97
4.1.3.3 Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) Terhadap Harga Saham Secara Parsial 98
4.1.3.4 Pengaruh *Return On Equity* (ROE) Terhadap Harga Saham Secara Parsial 103
4.1.3.5 Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) dan *Return On Equity* (ROE) Terhadap Harga Saham Secara Simultan 107
4.2 Pembahasan 111
4.2.1 Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) Terhadap Harga Saham..111
4.2.2 Pengaruh *Return On Equity* (ROE) Terhadap Harga Saham...114
4.2.3 Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) dan *Return On Equity* (ROE) Terhadap Harga Saham.....116
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN
5.1 Kesimpulan.....119
5.2 Saran.....121
DAFTAR PUSTAKA 124
LAMPIRAN.....128
DAFTAR RIWAYAT HIDUP 263

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Paradigma Penelitian.....33

Gambar 3.1 Daerah Penerimaan dan Penolokan H_0 Pada Uji t 60

Gambar 3.2 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Pada Uji F.....62

Gambar 4.1 Grafik Perkembangan *Earning Per Share* Pada Perusahaan Perbankan Tahun 2009-2012 82

Gambar 4.2 Grafik Perkembangan *Return On Equity* Pada Perusahaan Perbankan Tahun 2009-2012 86

Gambar 4.3 Grafik Perkembangan Harga Saham Pada Perusahaan Perbankan Tahun 2010-2013 89

Gambar 4.4 Grafik Normalitas *Probability Plot*.....92

Gambar 4.5 Hasil Pengujian Heterkedastisitas 94

Gambar 4.6 Daerah Kriteria Pengujian Autokorelasi 96

Gambar 4.7 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_1 Terhadap Y 102

Gambar 4.8 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_2 Terhadap Y 106

Gambar 4.9 Daerah Penerimaan dan Penolakan Pada Pengujian Hipotesis Secara Simultan (Uji Statistik F).....111

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 *Earning Per Share* (EPS) dan Harga Saham Pada Perusahaan Sektor Perbankan Yang Terdaftar Di BEI 2009-2012.....7

Tabel 1.2 Waktu Penelitian.....16

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu 25

Tabel 3.1 Desain Penelitian.....38

Tabel 3.2 Operasional Variabel.....41

Tabel 3.3 Daftar Perusahaan Yang Dijadikan Populasi 44

Tabel 3.4 Daftar Perusahaan Yang Dijadikan Sampel.....46

Tabel 3.5 Daftar Perbankan Yang Menjadi Sampel Penelitian.....47

Tabel 3.6 Interpretasi Koefisien Korelasi 56

Tabel 4.1 Perkembangan *Earning Per Share* (EPS) Pada Sektor Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2009-2012 80

Tabel 4.2 Perkembangan *Return On Equity* (ROE) Pada Sektor Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2009-2012 84

Tabel 4.3 Perkembangan Harga Saham Pada Sektor Perbankan yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2013 87

Tabel 4.4 Hasil Pengujian Normalitas 92

Tabel 4.5 Hasil Pengujian Multikolinieritas 93

Tabel 4.6 Hasil Pengujian Autokorelasi Nilai Durbin-Watson.....95

Tabel 4.7 Hasil Pengujian *Run Test* 96

Tabel 4.8 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda.....97

Tabel 4.9 Koefisien Korelasi *Earning Per Share* Dengan Harga Saham 99

Tabel 4.10 Koefisien Determinasi Parsial.....100

Tabel 4.11 Tabel Uji Parsial (T) 101

Tabel 4.12 Keofisien Korelasi *Return On Equity* Dengan Harga Saham 103

Tabel 4.13 Analisis Koefisien Korelasi Berganda Dan Koefisien Determinasi Simultan 107

Tabel 4.14 Tabel ANOVA Untuk Uji Simultan (F).....109

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Surat Rekomendasi Penelitian dari Unikom.....129

Lampiran 2 Surat Balasan Bursa Efek Indonesia.....130

Lampiran 3 Surat Keterangan Publikasi 131

Lampiran 4 Lembar Revisi Sidang Usulan Penelitian 132

Lampiran 5 Lembar Revisi Sidang Skripsi 133

Lampiran 6 Berita Acara Bimbingan Skripsi.....135

Lampiran 7 Kartu Peserta Sidang Seminar Usulan Penelitian.....137

Lampiran 8 Keterangan Bebas Pinjam Perpustakaan 138

Lampiran 9 Struktur Organisasi Bursa Efek Indonesia.....139

Lampiran 10 Tabel Perhitungan *Earning Per Share* (EPS).....140

Lampiran 11 Tabel Perhitungan *Return On Equity* (ROE).....142

Lampiran 12 Laporan Keuangan PT Bank Ekonomi Raharja 2009-2012 144

Lampiran 13 Laporan Keuangan PT Bank Central Asia 2009-2012 150

Lampiran 14 Laporan Keuangan PT Bank Nasional Indonesia 2009-2012 157

Lampiran 15 Laporan Keuangan PT Nusantara Parahyangan 2009-2012.....165

Lampiran 16 Laporan Keuangan PT Bank Rakyat Indonesia 2009-2012 171

Lampiran 17 Laporan Keuangan PT Bank Danamon 2009-2012.....179

Lampiran 18 Laporan Keuangan PT Bank Mandiri 2009-2012 187

Lampiran 19 Laporan Keuangan PT Bank Bumi Arta 2009-2012 194

Lampiran 20 Laporan Keuangan PT Bank CIMB Niaga 2009-2012 200

Lampiran 21 Laporan Keuangan PT Bank Permata 2009-2012 208

Lampiran 22 Laporan Keuangan PT Bank Mayapada Internasional 2009-2012.217

Lampiran 23 Laporan Keuangan PT Bank Mega 2009-2012 225

Lampiran 24 Laporan Keuangan PT Bank OCBC NISP 2009-2012.....231

Lampiran 25 Laporan Keuangan PT Bank Pan Indonesia 2009-2012.....237