DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

SURAT KETERANGAN PERSETUJUAN PUBLIKASI

PERNYATAAN KEASLIAN

MOTTO

ABSTRAK v

ABSTRACT.....vi

KATA PENGANTAR.....vii

DAFTAR ISI x

DAFTAR GAMBAR.....xiv

DAFTAR TABEL xv

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 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.....13
2.1.1 *Earning Per Share* (EPS).....13
2.1.2 *Net Profit Margin* (NPM).....16
2.1.3 Saham.....18
2.1.4 Harga Saham 22
2.1.5 Hasil Penelitian Sebelumnya.....27
2.1 Kerangka Pemikiran 29
2.2.1 Keterkaitan Antar Variabel 31
2.3 Hipotesis.....34

BAB III - OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian.....36
3.2 Metode Penelitian.....36
3.2.1 Desain Penelitian.....37
3.2.2 Operasionalisasi Variabel.....40

3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data.....43

3.2.5 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesi 48

BAB IV - HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian 61

4.1.1 Gambaran umum Bursa Efek Indonesia 61

4.1.2 Analisis Deskriptif 78

4.1.2.1 Analisis Deskriptif *Earning Per Share* (EPS).....78

4.1.2.2 Analisis Deskriptif *Net Profit Margin* (NPM) 83

4.1.2.3 Analisis Deskriptif Harga Saham.....88

4.1.3 Analisis Verifikatif 92

4.1.3.1 Pengaruh *Earning Per Share* Terhadap Harga Saham Secara Parsial.....98

4.1.3.2 Pengaruh *Net Profit Margin* Terhadap Harga Saham Secara Parsial 105

4.1.3.3 Pengaruh *Earning Per Share* dan *Net Profit Margin* Terhadap Harga Saham Secara Simultan 111

4.1 Pembahasan.....118

4.2.1 Analisis Pengaruh *Earning Per Share* Terhadap Harga Saham.....118

4.1.2 Analisis Pengaruh *Net Profit Margin* Terhadap Harga Saham.....120

4.1.3 Pengaruh *Earning Per Share* dan *Net Profit Margin* Secara Simultan Terhadap Harga Saham.....123

BAB V - KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan.....125

5.2 Saran.....126

DAFTAR PUSTAKA.....129

LAMPIRAN

RIWAYAT HIDUP

DAFTAR GAMBAR

Halaman

Gambar 2.2 Paradigma Penelitian.....34

Gambar 3.1 Daerah Penerimaan dan Penolakan Hipotesis.....61

Gambar 4.1 Grafik Rata-rata *Earning Per Share* pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012.....79

Gambar 4.2 Grafik Rata-rata *Net Profit Margin* pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012.....85

Gambar 4.3 Grafik Rata-rata Harga Saham pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012.....89

Gambar 4.4 Penggambaran Tabel Durbin-Watson pada Hasil Pengujian Asumsi Autokorelasi.....97

Gambar 4.5 Grafik Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 pada Hasil Pengujian Pengaruh *Earning Per Share*Terhadap Harga SahamSecara Parsial (Uji Statistik t).....102

Gambar 4.6 Grafik Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 pada Hasil Pengujiaan Pengaruh *Net Profit Margin* Terhadap Harga Saham Secara Parsial (Uji Statistik t).....109

Gambar 4.7 Grafik Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 pada Hasil Pengujian Model Regresi Secara Simultan (Uji Statistik F).....116

DAFTAR TABEL

Halaman

Tabel 1.1 *Earning per Share* (EPS), *Net Profit Margin* (NPM) dan Harga Saham pada Perusahaan Telekomunikasi yang Terdaftar di BEI Pada tahun 2007 – 2012 6

Tabel 1.2 Waktu Penelitian 12

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu 27

Tabel 3.1 Desain Penelitian.....39

Tabel 3.2 Operasional Variabel.....42

Tabel 3.3 Daftar Perusahaan yang Dijadikan Populasi 45

Tabel 3.4 Daftar Perusahaan yang Dijadikan Sampel.....47

Tabel 3.6 Interpretasi Koefisien Korelasi 55

Tabel 4.1 *Earning Per Share* pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012 78

Tabel 4.2 *Net Profit Margin* pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012 84

Tabel 4.3Harga Saham pada Perusahaan Periklanan, Percetakan, dan Media Periode 2007-2012 88

Tabel 4.4Hasil Pengujian Asumsi Normalitas 93

Tabel 4.5 Hasil Pengujian Asumsi Multikolinieritas 94

Tabel 4.6 Hasil Pengujian Asumsi Heteroskedatisitas.....95

Tabel 4.7 Hasil Pengujian Asumsi Autokorelasi 96

Tabel 4.8 Hasil Perhitungan Model Regresi Linier Berganda 97

Tabel 4.9 Hasil Pengujian Koefisien Korelasi Parsial Antara *Earning Per Share* dengan Harga Saham 99

Tabel 4.10 Hasil Pengujian Pengaruh *Earning Per Share*Terhadap Harga Saham Secara Parsial (Uji Statistik t) 102

Tabel 4.11 Hasil Pengujian Koefisien Korelasi Parsial Antara *Net Profit Margin* dengan Harga Saham.....105

Tabel 4.12 Hasil Pengujian Pengaruh *Net Profit Margin* Terhadap Harga Saham Secara Parsial (Uji Statistik t) 108

Tabel 4.13 Hasil Pengujian Koefisien Korelasi Secara Simultan 112

Tabel 4.14 Hasil Pengujian Koefisien Determinasi 113

Tabel 4.15 Hasil Pengujian Model Regresi Secara Simultan (Uji Statistik F).....115