

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERNYATAAN.....	ii
ABSTRAK	iii
HALAMAN PERSETUJUAN	v
HALAMAN PENGESAHAN	vi
RIWAYAT HIDUP	vii
SANWACANA	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.4.1 Manfaat Teoritis	5
1.4.2 Manfaat Praktis	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	6
2.1. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	6
2.2 Harga Saham	7
2.3 Rasio Keuangan	7
2.3.1 ROE (<i>Return On Equity</i>).....	7
2.3.2 EPS (<i>Earning Per Share</i>).....	8
2.3.3 DER (<i>Debt to Equity Ratio</i>)	8
2.3.4 CAR (<i>Capital Adequacy Ratio</i>)	9
2.3.5 ROA (<i>Return On Asset</i>)	9
2.4 Penelitian Terdahulu	9
2.5 Kerangka Pemikiran.....	12
2.6 Pengembangan Hipotesis Penelitian	12

2.6.1 Pengaruh <i>Return On Equity</i> Terhadap Harga Saham	12
2.6.2 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap Harga Saham.....	13
2.6.3 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap Harga Saham.....	13
2.6.4 Pengaruh <i>Capital Adequacy Ratio</i> Terhadap Harga Saham	14
2.6.5 Pengaruh <i>Return On Asset</i> Terhadap Harga Saham.....	14
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	16
3.1 Jenis Penelitian	16
3.2 Populasi dan Sampel	16
3.2.1 Populasi	16
3.2.2 Sampel.....	17
3.3 Jenis dan Sumber Data	17
3.3.1 Jenis Data	17
3.3.2 Sumber Data	17
3.3.3 Teknik Pengumpulan Data	17
3.4 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	18
3.5 Metode Analisis Data	20
3.5.1 Analisis Regresi Data Panel	20
3.5.2 Tahapan Analisis Regresi Data Panel	21
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	27
4.1 Deskripsi Data Penelitian.....	27
4.2 Statistik Deskriptif Variabel.....	28
4.3 Uji Asumsi Klasik	29
4.3.1 Uji Heterokedastisitas	29
4.3.2 Uji Multikolinieritas.....	30
4.4 Hasil Regresi Data Panel.....	30
4.4.1 Regresi Data Panel	30
4.4.1.1 <i>Common Effect Model</i> (CEM)	31
4.4.1.2 <i>Fixed Effect Model</i> (FEM)	32
4.4.1.3 <i>Random Effect Model</i> (REM).....	33
4.4.2 Uji Signifikansi Model Regresi Data Panel	34
4.4.2.1 Uji Chow	34
4.4.2.2 Uji Hausman	35
4.4.2.3 Uji Lagrange Multiplier	35
4.5 Pengujian Hipotesis.....	36
4.5.1 Uji F (Uji Kelayakan Model)	38
4.5.2 Uji R^2 (Koefisien Determinasi)	39
4.5.3 Uji t	39

4.6 Pembahasan	41
4.6.1 Pengaruh <i>Return On Equity</i> Terhadap Harga	41
4.6.2 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap Harga Saham.....	41
4.6.3 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap Harga Saham	42
4.6.4 Pengaruh <i>Capital Adequacy Ratio</i> Terhadap Harga Saham	43
4.6.5 Pengaruh <i>Return On Asset</i> Terhadap Harga Saham.....	44
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	45
5.1 Kesimpulan	45
5.2 Keterbatasan.....	45
5.3 Saran.....	46
DAFTAR PUSTAKA	..
LAMPIRAN	..

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar <i>Big Bank</i>	2
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	10
Tabel 4.1 Prosedur dan Hasil Pemilihan Sampel Perusahaan	26
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Variabel	27
Tabel 4.3 Hasil Uji Heterokedastisitas	28
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas	29
Tabel 4.5 Regresi <i>Common Effect Model</i> (CEM)	30
Tabel 4.6 Regresi <i>Fixed Effect Model</i> (FEM).....	31
Tabel 4.7 Regresi <i>Random Effect Model</i> (REM)	32
Tabel 4.8 Hasil Uji <i>Chow</i>	33
Tabel 4.9 Hasil Uji <i>Hausman</i>	34
Tabel 4.10 Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	35
Tabel 4.11 Model Terbaik <i>Fixed Effect Model</i> (FEM)	36
Tabel 4.12 Hasil Uji F	37
Tabel 4.13 Hasil Uji t	39