

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Tugas akhir	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.4.1 Manfaat Teoritis	8
1.4.2 Manfaat Praktis	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Teori Sinyal.....	10
2.1.2 Pasar Modal	11
2.1.3 Harga Saham	13
2.1.4 <i>Price Earning Ratio</i> (PER)	15
2.1.5 <i>Price to Book Value</i> (PBV) terhadap Harga Saham.....	16
2.1.6 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	16
2.1.7 <i>Current Ratio</i> (CR).....	17
2.1.8 <i>Return on Assets</i> (ROA)	18
2.2 Penelitian Terdahulu	20
2.3 Orisinalitas Penelitian	22
2.4 Hipotesis.....	23
2.5 Kerangka Penelitian	26
BAB III METODE PENELITIAN	28
3.1 Desain Penelitian	28
3.2 Jenis dan Sumber Data	28
3.3 Teknik Pengumpulan Data	29
3.4 Populasi dan Sampel	30
3.5 Variabel dan Definisi Operasional.....	31
3.5.1 Variabel Dependen (Y).....	31
3.5.2 Variabel Independen (X)	31
3.6 Teknik Analisis Data.....	32

3.6.1	Statistik Deskriptif.....	33
3.6.2	Estimasi Regresi Data Panel	33
3.6.3	Uji Asumsi Klasik	35
3.6.4	Estimasi Model Final.....	37
3.6.5	Uji Hipotesis	38
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		42
4.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	42
4.1.1	Harga Saham (Y).....	42
4.1.2	<i>Price to Earning Ratio</i> (PER)	43
4.1.3	<i>Price to Book Value</i> (PBV).....	44
4.1.4	<i>Debt to Equity Ratio</i> (DER).....	44
4.1.5	<i>Currennt Ratio</i> (CR).....	45
4.1.6	<i>Return On Asset</i> (ROA).....	46
4.2	Uji Pemiihan Model Panel	46
4.2.1	Uji <i>Chow</i>	47
4.2.2	Uji <i>Hausman</i>	47
4.2.3	Uji <i>Lagrange Multiplier</i> (LM) <i>Breusch-Pagan</i>	49
4.3	Uji Asumsi Klasik.....	50
4.3.1	Uji Normalitas.....	50
4.3.1.1	Grafik Histogram Residual.....	51
4.3.2	Uji Multikolinearitas	52
4.3.2.1	Hasil Matriks Korelasi Antar Variabel Independen.....	52
4.3.2.2	Hasil Uji <i>Variance Inflation Factor</i> (VIF)	53
4.3.3	Uji Heteroskedastisitas	53
4.3.4	Uji Autokorelasi	54
4.4	Hasil Estimasi Model Final	55
4.5	Uji Hipotesis	57
4.5.1	Uji Simultan (Uji <i>Wald</i>)	57
4.5.2	Koefisien Determinasi (R ²)	58
4.5.3	Uji Parsial (Uji Z).....	59
4.5.3.1	Pengaruh PER terhadap Harga Saham	59
4.5.3.2	Pengaruh PBV terhadap Harga Saham.....	60
4.5.3.3	Pengaruh DER terhadap Harga Saham	61
4.5.3.4	Pengaruh CR terhadap Harga Saham	61
4.5.3.5	Pengaruh ROA terhadap Harga Saham	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		63
5.1	Kesimpulan.....	63
5.1.1	Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> (PER) terhadap Harga Saham.....	63
5.1.2	Pengaruh <i>Price to Book Value</i> (PBV) terhadap Harga Saham.....	63
5.1.3	Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER) terhadap Harga Saham.....	64
5.1.4	Pengaruh <i>Current Ratio</i> (CR) terhadap Harga Saham	64
5.1.5	Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) terhadap Harga Saham	65

5.1.6	Pengaruh PER, PBV, DER, CR, dan ROA secara Simultan terhadap Harga Saham.....	65
5.2	Saran.....	66
5.2.1	Bagi Manajemen Perusahaan	66
5.2.2	Bagi Investor	67
5.2.3	Bagi Penelitian Selanjutnya	67
5.2.4	Bagi Regulator	67
5.3	Keterbatasan Penelitian	68
DAFTAR PUSTAKA		69
LAMPIRAN		73
Lampiran 1 Data Regresi.....		73
Lampiran 2. Hasil Statistik Deskriptif		77
Lampiran 3 Hasil Uji <i>Chow</i>		77
Lampiran 4 Hasil Uji <i>Hausman</i>		77
Lampiran 5 Hasil Uji <i>LM Breusch-Pagan</i>		78
Lampiran 6 Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro-Wilk</i>		78
Lampiran 7 Hasil Matriks Korelasi Antar Variabel Independen.....		79
Lampiran 8 Hasil Uji Variance Inflation Factor (VIF)		79
Lampiran 9 Hasil Uji Heteroskedastisitas		79
Lampiran 10 Uji Autokorelasi Wooldridge.....		80
Lampiran 11 Hasil Estimasi <i>Random Effect</i> dengan <i>Robust Standard Error</i>		80
Lampiran 12 Hasil Uji <i>Wald</i>		80
Lampiran 13 Hasil Koefisien Determinasi R ²		81