

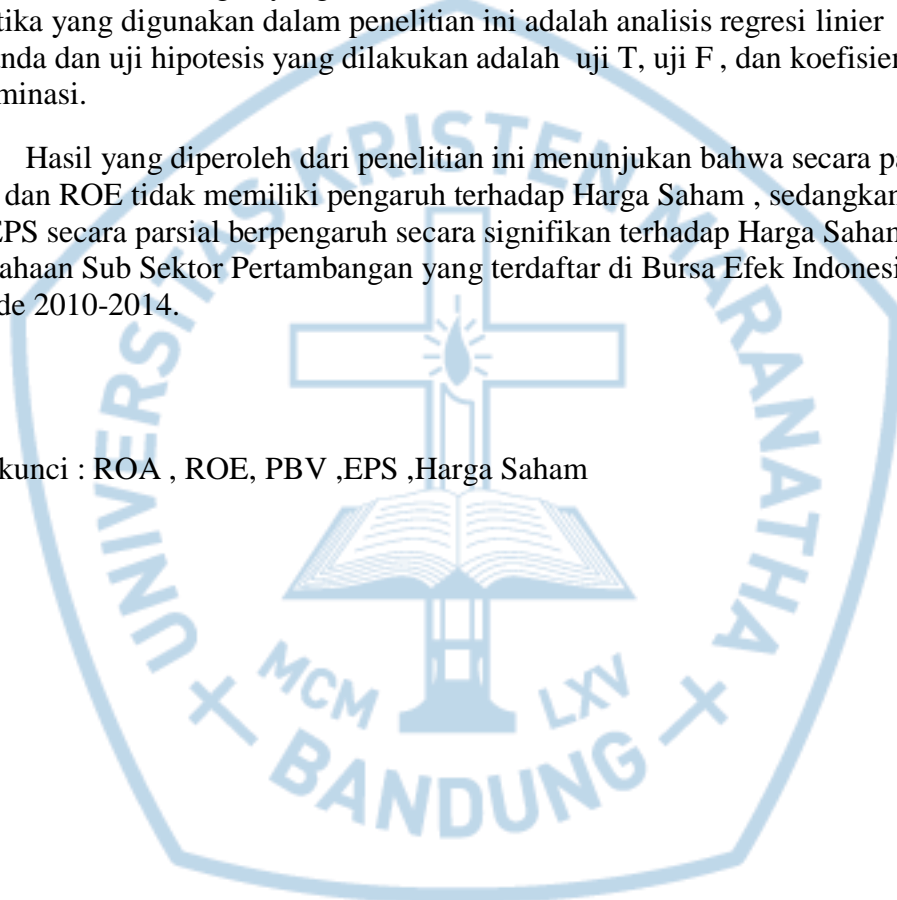
ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis terjadinya pengaruh pada harga saham yang dimana ROA (*Return On Asset*), ROE (*Return On Equity*), PBV (*Price to Book Value*) dan EPS (*Earning Per Share*) merupakan variabel independen yang diduga mempengaruhi Harga Saham perusahaan Sub Sektor Pertambangan tahun 2010-2014 yang merupakan variabel dependen.

Jumlah sample yang digunakan dalam penelitian ini adalah 6 perusahaan Sub Sektor Pertambangan yang terdaftar di BEI (Bursa Efek Indonesia). Metode statistika yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linier berganda dan uji hipotesis yang dilakukan adalah uji T, uji F, dan koefisien determinasi.

Hasil yang diperoleh dari penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial ROA dan ROE tidak memiliki pengaruh terhadap Harga Saham, sedangkan PBV dan EPS secara parsial berpengaruh secara signifikan terhadap Harga Saham perusahaan Sub Sektor Pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2014.

Kata kunci : ROA, ROE, PBV, EPS, Harga Saham



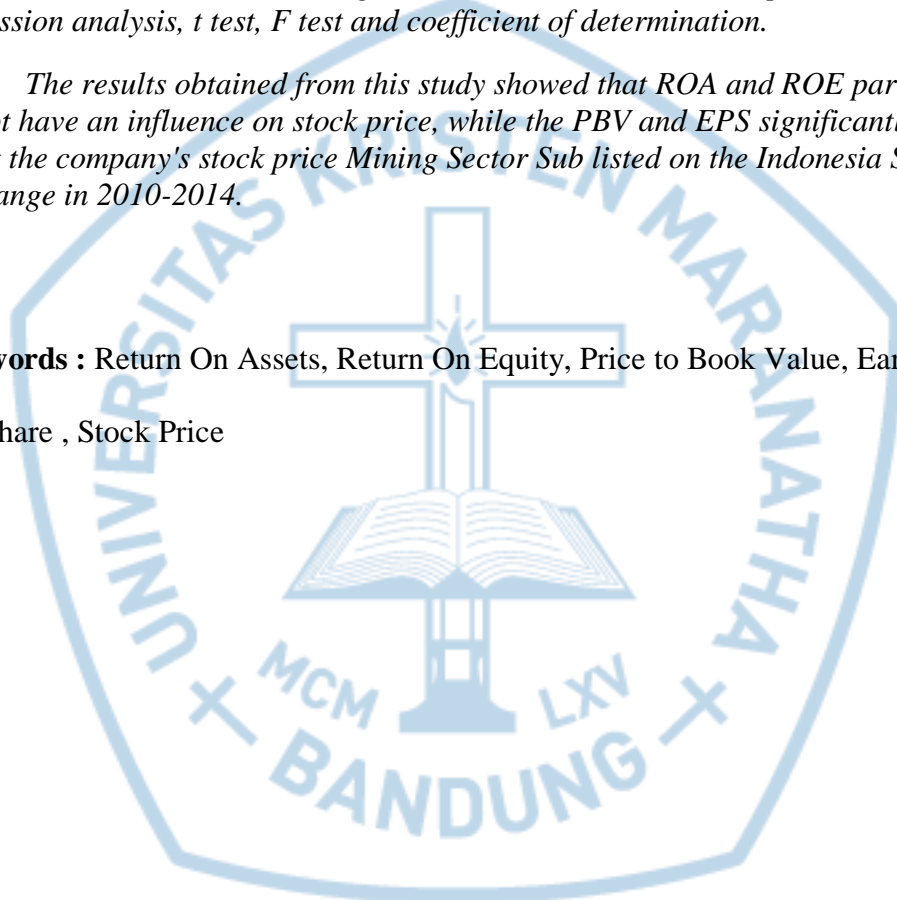
ABSTRACT

The aim of this research was to determine the effect on stock prices where the ROA (Return On Assets), ROE (Return On Equity), PBV (Price to Book Value), and EPS (Earning Per Share) are the independent variable that is thought affect the stock price of the mining company sub-Sector in 2010-2014 which is the dependent variable.

The sample used in this study was 6 Mining Sub Sector company listed on the IDX (Indonesia Stock Exchange). Statistical tool used is multiple linear regression analysis, t test, F test and coefficient of determination.

The results obtained from this study showed that ROA and ROE partially do not have an influence on stock price, while the PBV and EPS significantly affect the company's stock price Mining Sector Sub listed on the Indonesia Stock Exchange in 2010-2014.

Keywords : Return On Assets, Return On Equity, Price to Book Value, Earning Per Share , Stock Price



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL BAHASA INDONESIA	i
HALAMAN JUDUL BAHASA INGGRIS	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	viii
<i>ABSTRACT</i>	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
BAB II KAJIAN PUSTAKA ,KERANGKA PEMIKIRAN DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	
2.1 Kajian Pustaka	8
2.1.1 Saham	8
2.1.1.1 Jenis-Jenis Saham	9
2.1.1.2 Harga Saham	11
2.1.1.3 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	12
2.1.2 Rasio Keuangan	14
2.1.3 Penelitian Terdahulu	25
2.2 Pengembangan Hipotesis	28
2.2.1 Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) dengan Harga Saham	28
2.2.2 Pengaruh <i>Return on Equity</i> (ROE) dengan Harga Saham	28
2.2.3 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> (PBV) dengan Harga Saham	29
2.2.4 Pengaruh <i>Earning Per Share</i> (EPS) dengan	

Harga Saham	30
2.2.5 Pengaruh ROA, ROE, PBV, dan EPS terhadap Harga Saham	30
2.2.5.1 Rerangka Pemikiran	31
2.2.5.2 Kerangka Konseptual	32

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Jenis Penelitian	33
3.2 Populasi dan Sample Penelitian	33
3.3 Definisi Operasional Variabel (DOV)	35
3.4 Teknik Pengumpulan Data	37
3.5 Teknik Analisis Data.....	37
3.5.1 Uji Asumsi Klasik	37
3.5.2 Uji Outlier	38
3.5.3 Uji Normalitas	38
3.5.4 Uji Multikolinearitas	39
3.5.5 Uji Heteroskedastisitas	39
3.5.6 Uji Autokorelasi	40
3.5.7 Pengujian Hipotesis	40
3.5.7.1 Uji T (Parsial)	41
3.5.7.2 Uji F (Simultan)	43
3.5.7.3 Koefisien Determinasi	43

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian	45
4.1.1 Deskripsi Variabel Penelitian	45
4.1.2 Uji Asumsi Klasik	50
4.1.2.1 Uji Outlier	50
4.1.2.2 Uji Normalitas	52
4.1.2.3 Uji Multikolinearitas	54
4.1.2.4 Uji Heteroskedastisitas	55
4.1.2.5 Uji Autokorelasi	56
4.1.3 Analisis Data	57
4.1.3.1 Regresi Linier Berganda	57
4.1.3.2 Uji Hipotesis Penelitian	59
4.1.3.3 Analisis Koefisien Determinasi	63
4.2 Pembahasan	64

BAB V PENUTUP

5.1 Simpulan	67
5.2 Keterbatasan Penelitian	68
5.3 Implikasi Penelitian	69
5.4 Saran	69

DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN	76
DAFTAR RIWAYAT HIDUP (<i>CURRICULUM VITAE</i>)	209



DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Harga Saham Perusahaan Sub Sektor Pertambangan Periode 2010-2014	4
Tabel 3.1 Sampel Penelitian Perusahaan Sub Sektor Pertambangan	34
Tabel 3.2 Definisi Operasional Variabel (DOV)	36
Tabel 4.1 Data ROA ,ROE, PBV, dan EPS Sub Sektor Pertambangan Di BEI 2010-2014	46
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif	49
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Outliers</i>	51
Tabel 4.4 Uji <i>Outliers</i> tahap 2	52
Tabel 4.5 Hasil Uji Normalitas	53
Tabel 4.6 Hasil Uji Multikolinearitas	54
Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas	56
Tabel 4.8 Hasil Uji Autokorelasi	57
Tabel 4.9 Hasil Regresi Linier Berganda 58	58
Tabel 4.10 Hasil Statistik Uji T	61
Tabel 4.11 Hasil Statistik Uji F	63
Tabel 4.12 Hasil Pengaruh Simultan	64

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran A	Laporan Keuangan Perusahaan	76
Lampiran B	Perhitungan ROA ,ROE ,PBV , dan EPS	188
Lampiran C	Harga Saham Perusahaan Sub Sektor Pertambangan Periode 2010-2014	201
Lampiran D	Output SPSS	203

