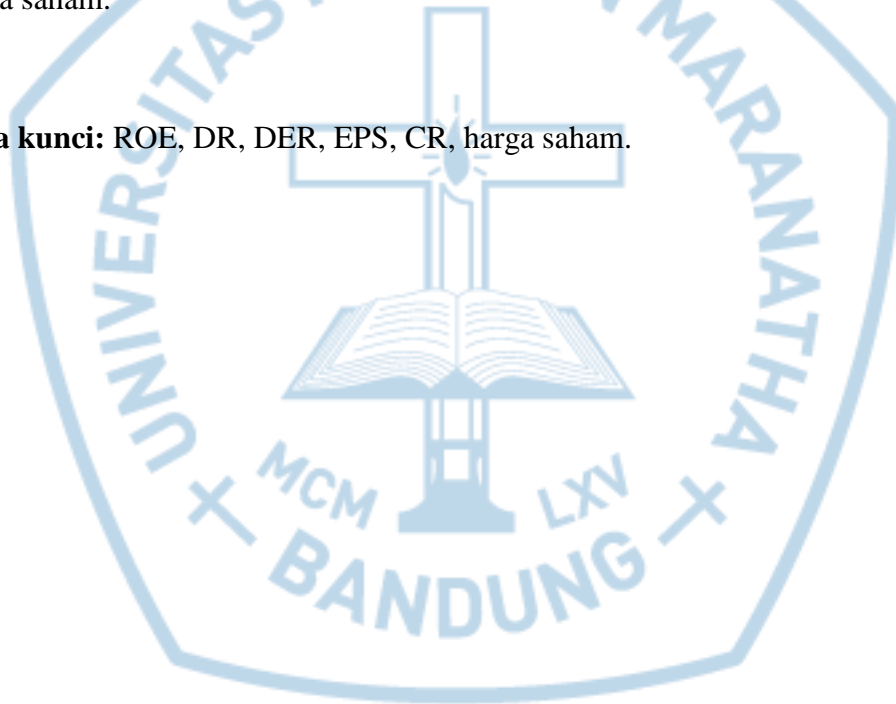


ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk memperoleh informasi mengenai pengaruh ROE, DR, DER, EPS dan CR terhadap harga saham. Data keuangan diambil dari perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2014-2016. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI), periode penelitian pada tahun 2014-2016 dan diperoleh 60 sampel data. Pengambilan sample dilakukan dengan metode *purposive sampling*. Harga saham yang digunakan dalam penelitian ini adalah harga penutupan akhir tahun (31 Desember). Hipotesis penelitian ini dianalisis dengan menggunakan metode regresi linier berganda dan uji F dengan tingkat signifikansi 5%. Secara simultan ROE, DR, DER, EPS dan CR memiliki pengaruh terhadap harga saham. Secara parsial hanya variabel ROE, DR, DER, EPS saja yang memiliki pengaruh terhadap harga saham.

Kata kunci: ROE, DR, DER, EPS, CR, harga saham.



ABSTRACT

This study aims to obtain information about the influence of ROE, DR, DER, EPS and CR against stock prices. Financial data is taken from a manufacturing company listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) 2014-2016. The population used in this study is a manufacturing company listed in Indonesia Stock Exchange (IDX), the period of research in 2014-2016 and obtained 60 data samples. Sampling is done by purposive sampling method. The stock price used in this study is the closing price of the end of the year (31 December). The hypothesis of this research was analyzed by using multiple linear regression method and F test with 5% significance level. Simultaneously ROE, DR, DER, EPS and CR have an influence on stock prices. Partially only variable ROE, DR, DER, EPS alone that have influence to stock price.

Keyword: ROE, DR, DER, EPS, CR, stock price.



DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN JUDUL BAHASA INGGRIS	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN TUGAS AKHIR.....	iv
PERNYATAAN PUBLIKASI LAPORAN PENELITIAN	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK.....	viii
<i>ABSTRACT</i>	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Kegunaan Penelitian.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	10
2.1 Tinjauan Pustaka	10
2.1.1 Teori Sinyal (Signalling Theory).....	10
2.1.2 Nilai Perusahaan	10
2.1.3 Harga Saham.....	11
2.1.3.1 Penilaian Harga Saham	11
2.1.3.2 Analisis Saham.....	11
2.1.4 Analisis Rasio Keuangan.....	13
2.1.4.1 Current Ratio	11
2.1.4.2 Debt Ratio	11
2.1.4.3 Debt to Equity Ratio	11
2.1.4.4 Earning Per Share.....	11
2.1.4.5 Return On Equity	11
2.1.5 Penelitian Terdahulu	18
2.2 Kerangka Pemikiran	21
2.3 Pengembangan Hipotesis	26
2.3.1 Hubungan antara <i>Return on Equity</i> (ROE) terhadap Harga Saham.....	26
2.3.2 Hubungan antara <i>Debt Ratio</i> (DR) terhadap Harga Saham.....	26
2.3.3 Hubungan antara <i>Debt Equity Ratio</i> (DER) terhadap Harga Saham ...	27
2.3.4 Hubungan antara <i>Earning Per Share</i> (EPS) terhadap Harga Saham...	27
2.3.5 Hubungan antara <i>Current Asset</i> (CR) terhadap Harga Saham	28

BAB III METODE PENELITIAN.....	11
3.1 Objek Penelitian	11
3.2 Populasi dan Sampel	11
3.3 Jenis dan Sumber Data	33
3.4 Metode Penelitian.....	34
3.5 Operasional Variabel.....	34
3.6 Teknik Analisis Data	37
3.6.1 Uji Asumsi Klasik.....	37
3.6.2 Uji Hipotesis	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	43
4.1 Hasil Penelitian.....	43
4.1.1 Uji Asumsi Klasik.....	43
4.1.2 Uji Hipotesis	48
4.2 Pembahasan	55
4.2.1 Pengaruh ROE terhadap Harga Saham	55
4.2.2 Pengaruh DR terhadap Harga Saham.....	56
4.2.3 Pengaruh DER terhadap Harga Saham.....	57
4.2.4 Pengaruh EPS terhadap Harga Saham	57
4.2.5 Pengaruh CR terhadap Harga Saham.....	58
BAB V SIMPULAN DAN PENUTUP	63
5.1 Simpulan.....	44
5.2 Saran.....	65
5.3 Keterbatasan Penelitian	65
DAFTAR PUSTAKA	64
LAMPIRAN.....	64
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	77

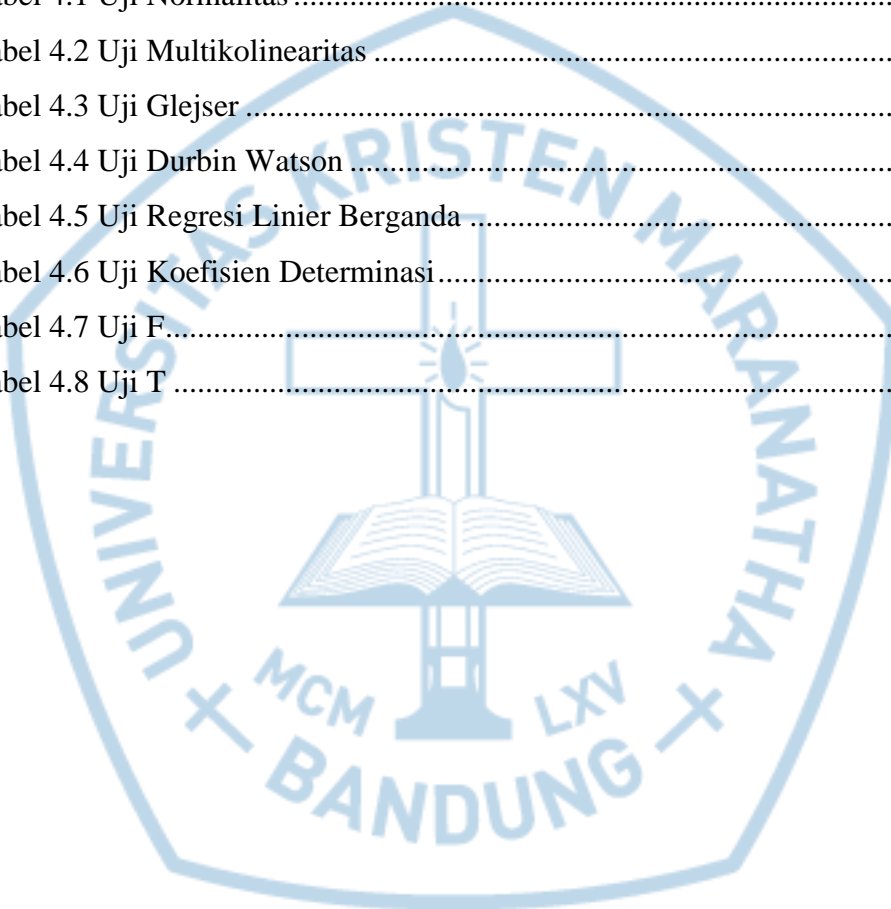
DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Model Kerangka Pemikiran.....	27



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Nilai Tukar Rupiah.....	2
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	19
Tabel 3.1 Sampel Penelitian.....	32
Tabel 3.2 Operasional Variabel.....	35
Tabel 4.1 Uji Normalitas.....	44
Tabel 4.2 Uji Multikolinearitas.....	45
Tabel 4.3 Uji Glejser.....	47
Tabel 4.4 Uji Durbin Watson.....	48
Tabel 4.5 Uji Regresi Linier Berganda.....	50
Tabel 4.6 Uji Koefisien Determinasi.....	52
Tabel 4.7 Uji F.....	53
Tabel 4.8 Uji T.....	56



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran A Daftar Sampel Perusahaan Manufaktur	70
Lampiran B Data Penelitian	71
Lampiran C Hasil Output SPSS 16	73

