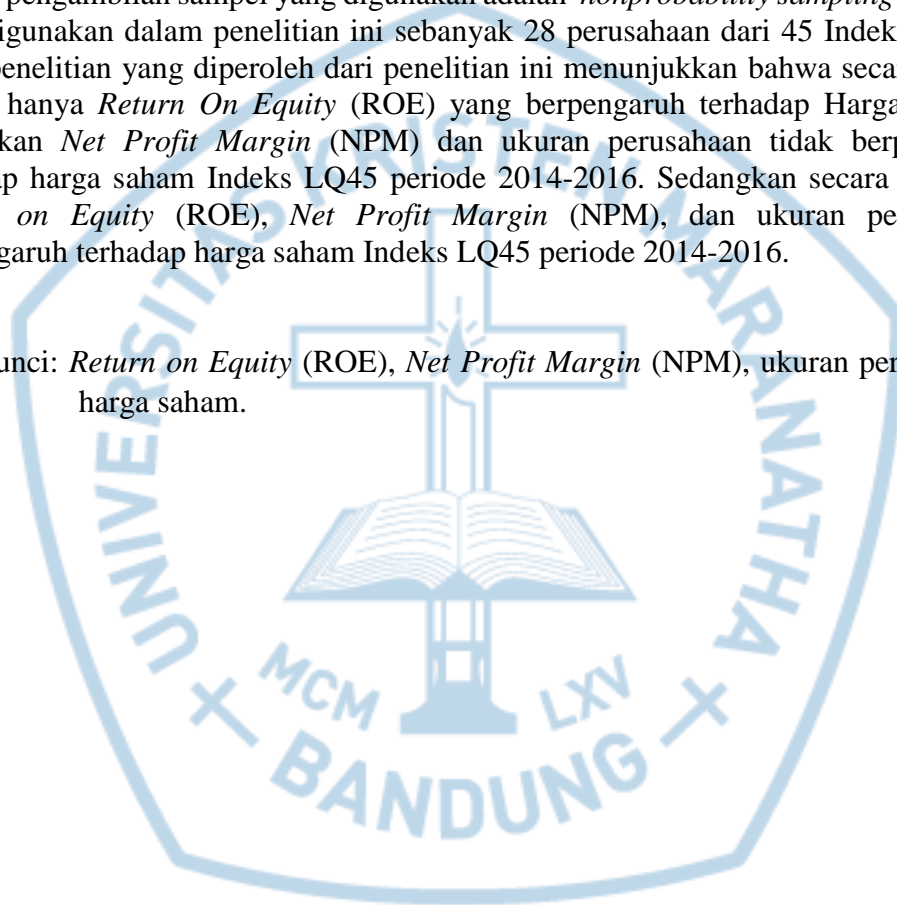


ABSTRAK

Harga saham merupakan faktor yang sangat penting dan harus diperhatikan oleh investor karena harga saham merupakan dasar bagi para investor dalam mengambil keputusan investasi seperti menjual, membeli atau menanam saham. Harga saham juga menunjukkan prestasi atas kinerja perusahaan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat *Return on Equity* (ROE), *Net Profit Margin* (NPM), dan ukuran perusahaan terhadap harga saham pada Indeks LQ45 periode 2014-2016. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah *nonprobability sampling*. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini sebanyak 28 perusahaan dari 45 Indeks LQ45.. Hasil penelitian yang diperoleh dari penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial hanya *Return On Equity* (ROE) yang berpengaruh terhadap Harga Saham, sedangkan *Net Profit Margin* (NPM) dan ukuran perusahaan tidak berpengaruh terhadap harga saham Indeks LQ45 periode 2014-2016. Sedangkan secara simultan *Return on Equity* (ROE), *Net Profit Margin* (NPM), dan ukuran perusahaan berpengaruh terhadap harga saham Indeks LQ45 periode 2014-2016.

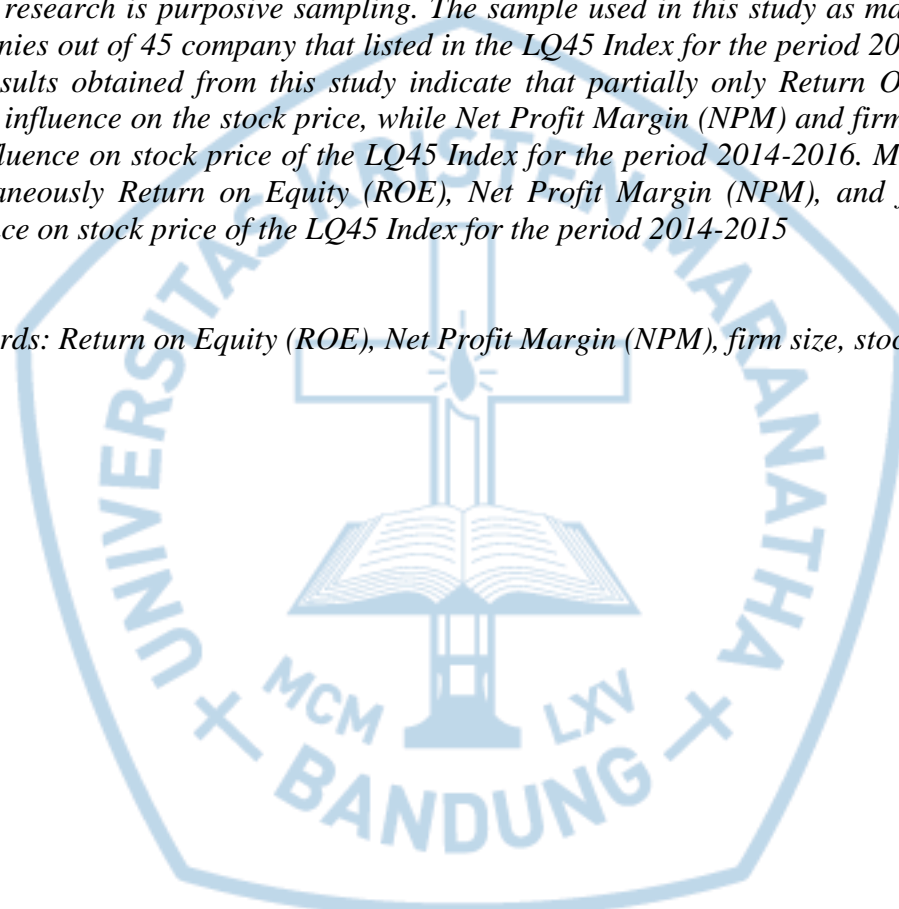
Kata kunci: *Return on Equity* (ROE), *Net Profit Margin* (NPM), ukuran perusahaan, harga saham.



ABSTRACT

Stock price is one of the important factor that should be noticed by investor because stock price is the base for the investor to take some investment action such as selling, buying, or investing a stock. Stock price is also shown firm's achievement on its performance. This research aimed to determine the influence of Return on Equity (ROE), Net Profit Margin (NPM), and firm size either simultaneously or partially on stock price of the LQ45 Index for the period 2014-2016. The sampling technique used in this research is purposive sampling. The sample used in this study as many as 28 companies out of 45 company that listed in the LQ45 Index for the period 2014-2016. The results obtained from this study indicate that partially only Return On Equity (ROE) influence on the stock price, while Net Profit Margin (NPM) and firm size are not influence on stock price of the LQ45 Index for the period 2014-2016. Meanwhile simultaneously Return on Equity (ROE), Net Profit Margin (NPM), and firm size influence on stock price of the LQ45 Index for the period 2014-2015

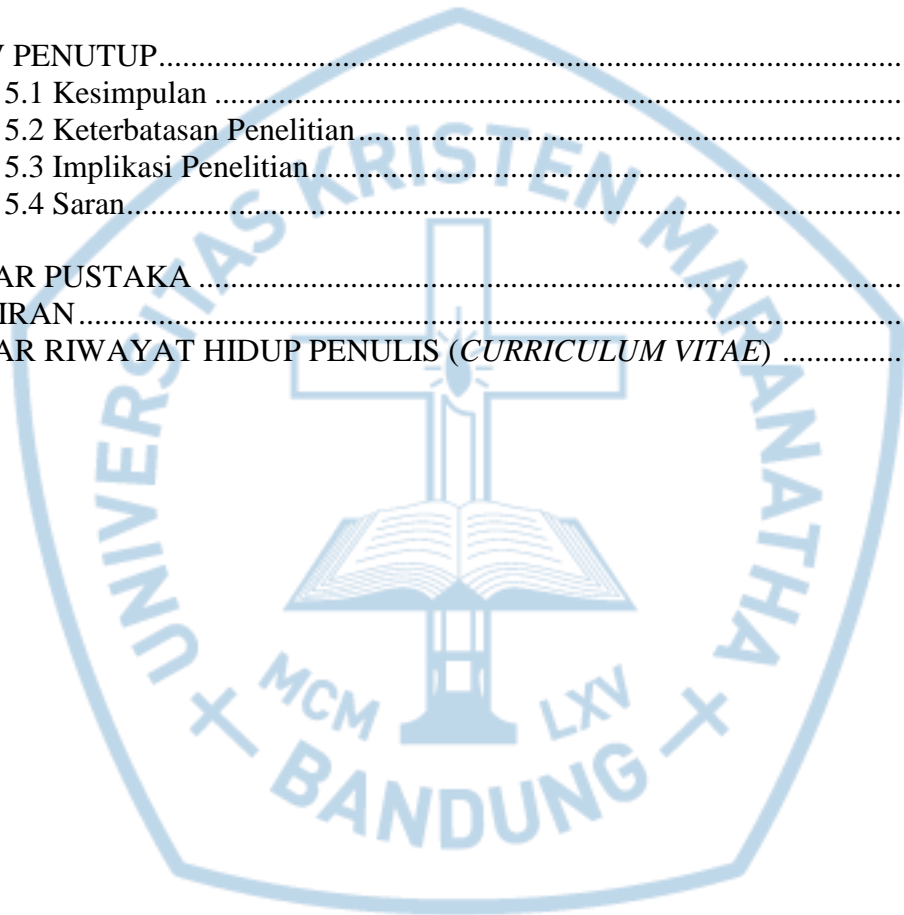
Keywords: Return on Equity (ROE), Net Profit Margin (NPM), firm size, stock price.



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iii
SURAT PERNYATAAN PUBLIKASI LAPORAN PENELITIAN	iv
KATA PENGANTAR	v
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 Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	9
2.1 Kajian Pustaka.....	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.1.1 Manfaat Pasar Modal	10
2.1.1.2 Jenis-jenis Pasar Modal.....	11
2.1.1.3 Instrumen Pasar Modal	12
2.1.2 Saham.....	13
2.1.2.1 Jenis-jenis Saham.....	13
2.1.2.2 Analisis Saham.....	15
2.1.3 Laporan Keuangan	16
2.1.3.1 Manfaat Laporan Keuangan.....	17
2.1.3.2 Jenis-jenis Laporan Keuangan	18
2.1.4 Rasio Profitabilitas.....	19
2.1.5 Harga Saham	2
2.1.6 Penelitian Terdahulu	24
2.1.7 Rerangka Teori.....	27
2.2 Rerangka Pemikiran	28
2.3 Pengembangan Hipotesis	29
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	31
3.1 Jenis Penelitian.....	31
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian	31
3.3 Definisi Operasional Variabel.....	33
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	34

3.5 Uji Asumsi Klasik.....	35
3.6 Metode Analisis Data.....	38
3.7 Uji Hipotesis Penelitian	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	41
4.1 Hasil Penelitian	41
4.1.1 Uji Asumsi Klasik.....	42
4.1.2 Metode Analisis Data.....	48
4.1.3 Uji Hipotesis Penelitian	50
4.2 Pembahasan.....	53
BAB V PENUTUP.....	55
5.1 Kesimpulan	55
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	55
5.3 Implikasi Penelitian.....	56
5.4 Saran.....	56
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN.....	61
DAFTAR RIWAYAT HIDUP PENULIS (<i>CURRICULUM VITAE</i>)	298



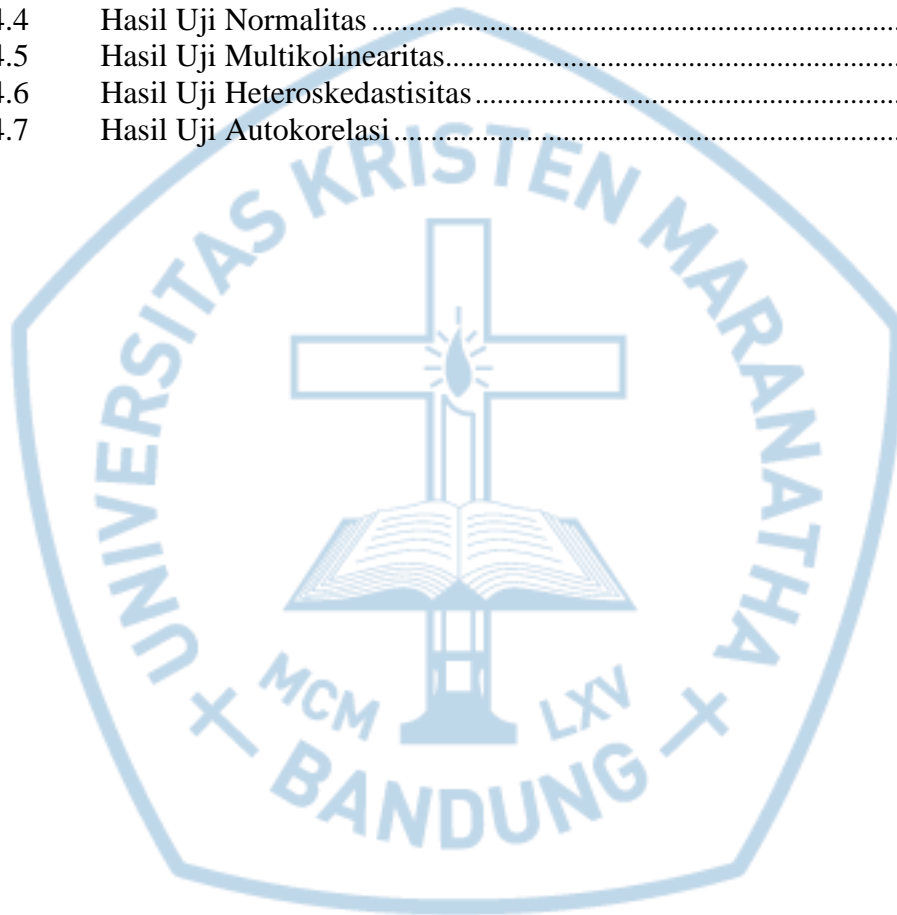
DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Rerangka Teori	26
Gambar 2.2	Rerangka Pemikiran.....	27



DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Daftar Harga Saham.....	5
Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3.1	Daftar Perusahaan Sampel	32
Tabel 3.2	Definisi Operasional Variabel	34
Tabel 4.1	Deskriptif Penelitian	41
Tabel 4.2	Hasil Uji Normalitas	43
Tabel 4.3	Hasil <i>Casewise Diagnostics</i>	44
Tabel 4.4	Hasil Uji Normalitas	44
Tabel 4.5	Hasil Uji Multikolinearitas.....	45
Tabel 4.6	Hasil Uji Heteroskedastisitas	47
Tabel 4.7	Hasil Uji Autokorelasi.....	48



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran A	Laporan Laba/Rugi	61
Lampiran B	Neraca	119
Lampiran C	Harga Saham Indeks LQ45	275
Lampiran D	Hasil Pengolahan Data.....	277

