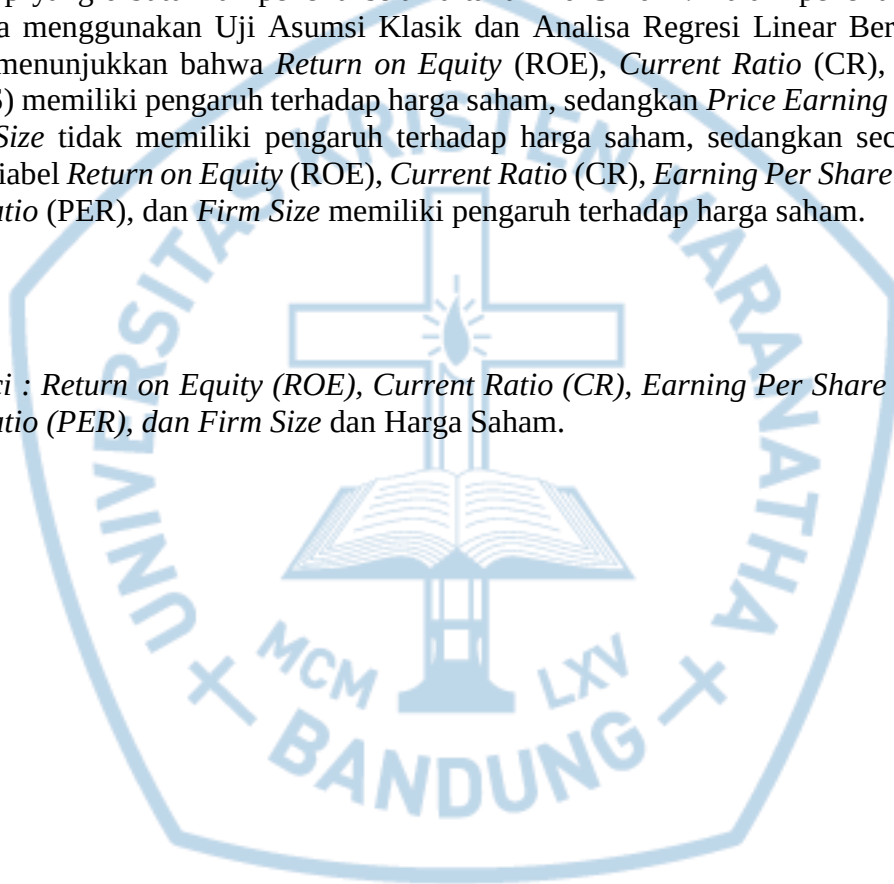


Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk membuktikan bahwa *Return on Equity* (ROE), *Current Ratio* (CR), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), dan *Firm Size*, berpengaruh terhadap Harga Saham secara Parsial dan Simultan pada Perusahaan *Property* dan *Real Estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan jenis penelitian *Causal Explanatory* yang menjelaskan hubungan antara variabel dan pengujian hipotesis yang telah dirumuskan sebelumnya dan bertujuan untuk menjelaskan berbagai kejadian dan fenomena penelitian. Sampel dalam penelitian ini adalah Perusahaan *Property* dan *Real Estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dan mem-publish laporan keuangannya secara berkala dan data lengkap yang dibutuhkan peneliti selama tahun 2013-2017. Dalam penelitian ini teknik analisa data menggunakan Uji Asumsi Klasik dan Analisa Regresi Linear Berganda. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Return on Equity* (ROE), *Current Ratio* (CR), *Earning Per Share* (EPS) memiliki pengaruh terhadap harga saham, sedangkan *Price Earning Ratio* (PER), dan *Firm Size* tidak memiliki pengaruh terhadap harga saham, sedangkan secara simultan seluruh variabel *Return on Equity* (ROE), *Current Ratio* (CR), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), dan *Firm Size* memiliki pengaruh terhadap harga saham.

Kata Kunci : Return on Equity (ROE), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), dan Firm Size dan Harga Saham.



Abstract

This study aims to prove that Return on Equity (ROE), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), and Firm Size, affect Partially and Simultaneous Stock Prices of Property and Real Companies Estate listed on the Indonesia Stock Exchange. This study uses a type of Causal Explanatory research that explains the relationship between variables and testing hypotheses that have been formulated previously and aims to explain various research events and phenomena. The samples in this study are Property and Real Estate Companies listed on the Indonesia Stock Exchange and publish their financial statements periodically and complete data needed by researchers during 2013-2017. In this study the data analysis technique used the Classical Assumption Test and Multiple Linear Regression Analysis. The results showed that Return on Equity (ROE), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS) had an influence on stock prices, while Price Earning Ratio (PER) and Firm Size had no effect on stock prices, while simultaneously all variables Return on Equity (ROE), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), and Firm Size have an influence on stock prices.

Keywords: Return on Equity (ROE), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), and Firm Size and Stock Prices.



DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN JUDUL DALAM BAHASA INGGRIS.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
SURAT KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK.....	vii
ABSTRACT.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan Penelitian.....	10
1.4 Manfaat Penelitian.....	11
 BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Kajian Pustaka.....	13
2.1.1 Investasi.....	13
2.1.1.1 <i>Real Assets</i>	13
2.1.1.2 <i>Financial Assets</i>	13
2.1.2 Pasar Modal.....	15
2.1.3 Lembaga Pasar Modal	16
2.1.4 Instrumen Pasar Modal.....	18
2.1.5 Harga Saham.....	20
2.1.6 Kinerja Harga Saham.....	23

2.1.7 Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham.....	24
2.1.8 Penelitian Terdahulu.....	28
2.2 Rerangka Teori	31
2.3 Rerangka Pemikiran.....	32
2.4 Pengembangan Hipotesis.....	33
 BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Jenis Penelitian	36
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian.....	36
3.3 Definisi Operasional Variabel.....	38
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	41
3.5 Teknik Analisis Data.....	41
3.5.1 Uji Asumsi Klasik.....	41
3.5.2 Analisis Regresi Berganda	43
3.5.3 Uji Hipotesis	44
 BAB IV Hasil Penelitian dan Pembahasan	
4.1 Hasil Penelitian.....	47
4.1.1 Analisis Deskripsi Penelitian.....	47
4.1.2 Uji Asumsi Klasik.....	48
4.1.3 Metode Analisis Data.....	52
4.1.4 Uji Hipotesis.....	53
4.2 Pembahasan.....	61
 BAB V Penutup	
5.1 Kesimpulan.....	65
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	66
5.3 Saran.....	66
DAFTAR PUSTAKA.....	67
LAMPIRAN.....	71
DAFTAR RIWAYAT HIDUP PENULIS (<i>CURRICULLUM VITAE</i>).....	86

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Rerangka Teori.....	31
Gambar 2.2 Rerangka Pemikiran.....	32



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1.8 Penelitian Terdahulu.....	28
Tabel 3.1 Perusahaan Yang Terdaftar Di BEI.....	36
Tabel 3.2 Definisi Operasional Variabel.....	39
Tabel 4.1 Analisa Deskriptif Variabel.....	46
Tabel 4.2 Uji Normalitas.....	48
Tabel 4.3 Uji Heterokesdatisitas.....	49
Tabel 4.4 Uji Multikolinearitas.....	50
Tabel 4.5 Uji Autokorelasi.....	51
Tabel 4.6 Uji T <i>Return on Equity</i> terhadap harga saham perusahaan.....	54
Tabel 4.7 Koefisien Determinasi <i>Return on Equity</i>	54
Tabel 4.8 Uji T <i>Current Ratio</i> terhadap harga saham perusahaan.....	55
Tabel 4.9 Koefisien Determinasi <i>Current Ratio</i>	55
Tabel 4.10 Uji T <i>Earning Per Share</i> terhadap harga saham perusahaan.....	56
Tabel 4.11 Koefisien Determinasi <i>Earning Per Share</i>	57
Tabel 4.12 Uji T <i>Price Earning Ratio</i> terhadap harga saham perusahaan.....	58
Tabel 4.13 Koefisien Determinasi <i>Price Earning Ratio</i>	58
Tabel 4.14 Uji T <i>Firm Size</i> terhadap harga saham perusahaan.....	59
Tabel 4.15 Koefisien Determinasi <i>Firm Size</i>	59
Tabel 4.16 Uji F Simultan terhadap harga saham perusahaan.....	61
Tabel 4.17 Koefisien Determinasi Uji F.....	62

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran A Lampiran Analisis Deskriptif Variabel Return on Equity.....	67
Lampiran B Lampiran Analisis Deskriptif Variabel <i>Current Ratio</i>	68
Lampiran C Lampiran Analisis Deskriptif Variabel <i>Earning Per Share</i>	69
Lampiran D Lampiran Analisis Deskriptif Variabel <i>Price Earning Ratio</i>	70
Lampiran E Lampiran <i>Firm Size</i> (Total Sebelum Ln).....	71
Lampiran F Lampiran Analisis Deskriptif Variabel <i>Firm Size</i>	73
Lampiran G Hasil SPSS.....	74

