

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	I
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	li
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	Vi
DAFTAR ISI	Vii
DAFTAR TABEL	X
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	11
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	12
1. Tujuan Penelitian	12
2. Kontribusi Penelitian	12
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	14
A. Kajian Pustaka	14
1. <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH)	14
2. <i>Signalling Theory</i>	16
3. Investasi	17
a) Pengertian Investasi	17
b) Tujuan Investasi	18
c) Jenis Investasi	19
4. Harga Saham	20
a) Pengertian Harga Saham	20
b) Jenis-Jenis Harga Saham	21
c) Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham	22
5. Kinerja Keuangan	25
a) Pengertian Kinerja Keuangan	25
b) Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Kinerja Keuangan	26
c) Pengukuran Kinerja Keuangan	26
d) Penilaian Kinerja Keuangan	28
6. Laporan Keuangan	29
7. Analisis Rasio Keuangan	29
a) Pengertian Rasio Keuangan	29
b) Jenis-jenis Rasio Keuangan	30

8. Kajian Penelitian Terdahulu	32
B. Pengembangan Hipotesis dan Rerangka Konseptual	37
1. Pengembangan Hipotesis Hubungan Antar Variabel	37
2. Rerangka Konseptual	40
BAB III METODE PENELITIAN	41
A. Waktu dan Tempat Penelitian	41
B. Desain Penelitian	41
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	42
1) Variabel Terikat (Variabel Dependen)	42
2) Variabel Bebas (Variabel Independen)	42
D. Populasi dan Sampel Penelitian	44
1) Populasi Penelitian	44
2) Sampel Penelitian	45
E. Teknik Pengumpulan Data	47
F. Metode Analisis Data	48
1) Analisis Deskriptif	48
2) Uji Stasioneritas	49
G. Metode Regresi Data Panel	50
1) <i>Common Effect (Pooled Least Square)</i>	50
2) <i>Fixed Effect (FE)</i>	51
3) <i>Random Effect (RE)</i>	52
H. Pemilihan Model Regresi Data Panel	53
1) Uji Chow	53
2) Uji Hausman	55
3) <i>Uji Lagrange Multiplier</i>	55
I. Uji Asumsi Klasik	57
1) Uji Normalitas Data	57
2) Uji Multikolinieritas	58
3) Uji Heteroskedastisitas	59
J. Pengujian Hipotesis	59
1) Koefisien Determinasi (R^2)	60
2) Uji F	61
3) Uji t	62
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	63
A. Gambaran Umum Obyek Penelitian	63
B. Statistik Deskriptif	64
C. Analisis Kelayakan Data	68
1. Uji Stasioneritas	68
D. Metode Regresi Data Panel	73
1. Model <i>Common Effect (Pooled Least Square)</i>	73
2. Model <i>Fixed effect (FEM)</i>	76

3.	Model <i>Random Effect</i> (REM)	79
E.	Hasil Pemilihan Model Regresi Data Panel	82
1.	Uji <i>Chow</i>	82
2.	Uji <i>Hausman</i>	83
F.	Uji Asumsi Klasik	84
1.	Uji Normalitas	84
2.	Uji Multikolinearitas	85
3.	Uji Heteroskedastisitas	87
G.	Hasil Uji Metode Regresi Data Panel	89
H.	Pengujian Hipotesis	89
1.	Koefisien Determinasi (R^2)	89
2.	Uji F	90
3.	Uji t	91
I.	Pembahasan	93
BAB V	SIMPULAN DAN SARAN	98
A.	Simpulan	98
B.	Saran	99
DAFTAR PUSTAKA		103
LAMPIRAN		106



UNIVERSITAS
MERCU BUANA