

DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN	
LEMBAR PERSEMBAHAN	
INTISARI.....	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii

BAB I PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2. Identifikasi Masalah	6
1.3. Maksud & Tujuan Masalah	7
1.4. Kegunaan Penelitian	8
1.5. Kerangka Pemikiran	9
1.6. Kerangka Bagan	19
1.7. Model Penelitian	20
1.8. Hipotesis	20

BAB II TINJAUAN PUSTAKA

2.1 Analisis Fundamental.....	21
2.1.1 Debt to Equity Rasio (DER).....	24
2.1.2 Return On Asset (ROA).....	27
2.1.3 Deviden Per Share (DPS).....	30

2.1.4 Price Book Value (PBV).....	35
2.2 Harga Saham	37
2.3 Pengaruh faktor-faktor fundamental terhadap Harga Saham	42
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Objek Penelitian	45
3.1.1 Sejarah Singkat	45
3.2 Metode Penelitian	49
3.2.1 Populasi dan Penarikan Sample	50
3.2.1.1 Populasi Sasaran Penelitian	50
3.2.1.2 Teknik Penarikan Sample	50
3.2.2 Oprasionalisasi Variable	53
3.2.3 Teknik Pengumpulan Data	56
3.2.4 Analisis Hasil	56
3.2.4.1 Analisis Perkembangan faktor fundamental	56
3.2.4.2 Analisis Pergerakan Harga Saham perusahaan	57
3.2.4.3 Analisis Statistik	57
3.2.5 Teknik Pengolahan Data	57
3.2.5.1 Prosedur Analisis Data	57
3.2.5.2 Pengujian Hipotesis	58

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Perkembangan faktor-faktor Fundamental pada 17 perusahaan yang masuk dalam kategori *Jakarta Islamic Index* (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia tahun 2009-2013

4.1.1 Analisis perkembangan <i>Debt to equity</i> (DER).....	62
4.1.2 Analisis perkembangan <i>Return On Asset</i> (ROA)	64
4.1.3 Analisis perkembangan <i>Deviden per Share</i> (DPS)	66
4.1.4 Analisis perkembangan <i>Price book value</i> (PBV).....	68

4.2 Perkembangan Harga Saham pada 17 perusahaan yang masuk dalam kategori *Jakarta Islamic Index* (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia tahun 2009-2013

71

4.3 Pengaruh faktor-faktor Fundamental (DER, ROA, DPS, PBV) terhadap Harga Saham perusahaan secara Parsial dan Simultan

74

4.3.1 Analisis Regresi Linear Berganda.....	74
4.3.1.1 Uji Normalitas Data.....	75
4.3.1.2 Uji Heteroskedastisitas	78
4.3.1.3 Uji Asumsi Autokorelasi	79
4.3.1.4 Uji Multikolinieritas	80
4.3.2 Uji Hipotesis	81
4.3.2.1 Pengujian Hipotesis Parsial (Uji T)	81
4.3.2.2 Pengujian Hipotesis Simultan (Uji F)	85
4.3.2.3 Analisis Koefisien Korelasi dan Determinasi	86

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 104

5.2 Saran 107

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN - LAMPIRAN



DAFTAR GAMBAR

4.1	P-P Plot Uji Normalitas Data	76
4.2	Scatterplot Uji Heteroskedastisitas	78

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Nilai Rata-rata Debt to equity(DER) (X1)	63
Tabel 4.2	Nilai Rata-rata Return On Asset (ROA) (X2)	66
Tabel 4.3	Nilai Rata-rata Deviden per share (DPS) (X3)	67
Tabel 4.4	Nilai Rata-rata Price book value (PBV) (X4)	69
Tabel 4.5	Nilai Rata-rata biaya Closing Price (Y)	72
Tabel 4.6	Hasil Uji Normalitas Data Metode Uji <i>Kolmogorov-Smirnov Z</i>	77
Tabel 4.7	Nilai Durbin-Watson Untuk Uji Asumsi Autokorelasi	79
Tabel 4.8	Hasil uji Asumsi Multikolinieritas	81
Tabel 4.9	Koefisien Regressi Nilai t hitung	82
Tabel 4.10	Koefisien Regressi Nilai f hitung	85
Tabel 4.11	Hasil uji Koefisien Determinasi	86

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Nilai rata - rata *Debt to equity*(DER) (X1) perusahaan - perusahaan yang masuk dalam kategori Jakarta Islamic Index (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia per 31 Desember 2010 s/d 2013 dalam (Rp)
- Lampiran 2 Nilai rata - rata *Return On Asset* (ROA) (X2) perusahaan - perusahaan yang masuk dalam kategori Jakarta Islamic Index (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia per 31 Desember 2010 s/d 2013 dalam (%)
- Lampiran 3 Nilai rata - rata *Deviden per share* (DPS) (X2) perusahaan - perusahaan yang masuk dalam kategori Jakarta Islamic Index (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia per 31 Desember 2010 s/d 2013 dalam (Rp)
- Lampiran 4 Nilai rata - rata *Price book value* (PBV) (X4) perusahaan - perusahaan yang masuk dalam kategori Jakarta Islamic Index (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia per 31 Desember 2010 s/d 2013 dalam (Rp)
- Lampiran 5 Nilai rata - rata biaya *Closing price* (Y) perusahaan - perusahaan yang masuk dalam kategori Jakarta Islamic Index (JII) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia per 31 Desember 2010 s/d 2013 dalam (Rp)
- Lampiran 9 Hasil uji SPSS
- Lampiran 10 Tabel Distribusi F
- Lampiran 11 Tabel Distribusi t