# DAFTAR ISI

Halaman Judul..... i
Surat Pernyataan Keaslian Tesis..... ii
Halaman Pengesahan ..... iii
*Abstract*..... iv
Abstrak..... v
Kata Pengantar..... vi
Daftar Isi..... viii
Daftar Tabel ..... xi
Daftar Gambar..... xii
Daftar Rumus.....xiii
Daftar Lampiran..... xiv
Bab I Pendahuluan..... 1
1.1 Latar Belakang..... 1
1.2 Perumusan Masalah..... 9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian..... 9
Bab II Telaah Pustaka dan Pengembangan Model Penelitian..... 11
2.1 Telaaah Pustaka..... 11
2.1.1 Investasi..... 11
2.1.2 Harga Saham..... 11
2.1.3 Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham..... 12
2.1.4 Kebijakan Dividen..... 14
2.1.5 *Earnings Per Share*..... 19
2.1.6 *Return on Equity*..... 19
2.2 Penelitian Terdahulu..... 20
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis..... 33
2.4 Hipotesis..... 33
Bab III Metode Penelitian..... 35
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional..... 35
3.1.1 Variabel Penelitian..... 35

3.1.2 Definisi Operasional..... 36
3.2 Populasi dan Sampel..... 38
3.2.1 Populasi ..... 38
3.2.2 Sampel ..... 38
3.3 Jenis dan Sumber Data..... 39
3.4 Metode Pengumpulan Data ..... 39
3.5 Metode Analisis Data..... 40
3.5.1 Uji Asumsi Klasik..... 40
3.5.1.1 Uji Normalitas..... 40
3.5.1.2 Uji Autokorelasi..... 41
3.5.1.3 Uji Multikolinieritas..... 42
3.5.1.4 Uji Heterokedastisitas ..... 42
3.5.2 Pengujian Hipotesis..... 43
3.5.2.1 Analisis Regresi..... 43
3.5.2.2 Uji F..... 44
3.5.2.3 Uji T..... 45
BAB IV ANALISA DATA DAN PEMBAHASAN..... 46
4.1 Analisa Data..... 46
4.1.1 Statistik Deskriptif..... 46
4.1.2 Hasil Uji Asumsi Klasik..... 50
4.1.3 Hasil Uji Fit Model (Uji F)..... 64
4.1.4 Hasil Uji Koefisien Regresi (Uji T)..... 65
4.1.5 Uji Koefisien Determinasi ($R^2$)..... 70
4.2 Pembahasan..... 73
4.2.1 Pengaruh DPR Terhadap Harga Saham..... 73
4.2.2 Pengaruh EPS Terhadap Harga Saham..... 74
4.2.3 Pengaruh ROE Terhadap Harga Saham..... 76
BAB V Simpulan dan Implikasi Kebijakan..... 79
5.1 Simpulan..... 78
5.2 Implikasi Teoritis..... 81
5.3 Implikasi Kebijakan..... 82

5.4 Keterbatasan Penelitian..... 82
5.5 Agenda Penelitian Mendatang..... 83
Daftar Referensi..... 84
Lampiran..... 88

FEB UNDIP