

DAFTAR ISI

| | Halaman |
|---|-----------|
| PENGESAHAN TESIS | ii |
| SERTIFIKASI | iii |
| <i>ABSTRACT</i> | iv |
| ABSTRAK | v |
| KATA PENGANTAR | vi |
| DAFTAR ISI | viii |
| DAFTAR TABEL | xi |
| DAFTAR GAMBAR | xii |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Perumusan Masalah | 14 |
| 1.3 Tujuan Penelitian | 16 |
| 1.4 Manfaat Penelitian | 16 |
| BAB II TINJAUAN PUSTAKA | 18 |
| 2.1 Landasan Teori | 18 |
| 2.1.1 <i>Irrelevance Theory</i> | 18 |
| 2.1.2 <i>The Bird in the Hand Theory</i> | 18 |
| 2.1.3 Pasar Modal | 19 |
| 2.1.4 Saham | 21 |
| 2.1.5 Keuntungan Kepemilikan Saham | 26 |
| 2.1.6 Dividen | 27 |
| 2.1.6.1 Bentuk Dividen | 27 |
| 2.1.6.2 Kebijakan Dividen | 28 |
| 2.1.7 Faktor – Faktor yang Berpengaruh Terhadap Harga Saham | 33 |
| 2.1.7.1 <i>Dividend Yield</i> | 33 |
| 2.1.7.2 <i>Retention Ratio</i> | 34 |
| 2.1.7.3 <i>Earning Per Share</i> | 35 |
| 2.1.7.4 <i>Return on Equity</i> | 36 |
| 2.2 Penelitian Terdahulu | 37 |

| | |
|--|-----------|
| 2.3. Hubungan Antar Variabel & Model Penelitian..... | 45 |
| 2.4 Perumusan Hipotesis | 55 |
| BAB III METODE PENELITIAN | 56 |
| 3.1 Rancangan Penelitian..... | 56 |
| 3.2 Jenis dan Sumber Data..... | 56 |
| 3.3 Populasi dan Sampel..... | 57 |
| 3.4 Metode Pengumpulan Data..... | 59 |
| 3.5 Definisi Operasional Variabel..... | 59 |
| 3.6 Metode Analisis Data | 62 |
| 3.6.1 Uji Statistik Deskriptif..... | 62 |
| 3.6.2 Uji Penyimpangan Asumsi Klasik | 63 |
| 3.6.2.1 Uji Normalitas..... | 63 |
| 3.6.2.2 Uji Multikolinearitas | 63 |
| 3.6.2.3 Uji Heteroskedastisitas | 64 |
| 3.6.2.4 Uji Autokorelasi | 65 |
| 3.7 Analisis Regresi Berganda..... | 65 |
| 3.7.1 Uji Parsial (<i>t-Test</i>)..... | 66 |
| 3.7.2 Uji Menyeluruh (Uji-F)..... | 66 |
| 3.7.3 Uji Koefisien Determinasi | 67 |
| 3.7.4 Uji <i>Chow Test</i> | 68 |
| BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN..... | 70 |
| 4.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian..... | 70 |
| 4.2 Statistik Deskriptif..... | 71 |
| 4.3 Hasil Uji Asumsi Klasik | 76 |
| 4.3.1 Uji Normalitas..... | 76 |
| 4.3.2 Uji Multikolinearitas | 81 |
| 4.3.3 Uji Autokorelasi..... | 83 |
| 4.3.4 Uji Heteroskedastisitas | 86 |
| 4.4 Hasil Analisis Regresi..... | 89 |
| 4.4.1 Uji Statistik F (ANOVA)..... | 89 |
| 4.4.2 Uji Statistik t (Pengujian Hipotesis)..... | 91 |

| | |
|--|-------------|
| 4.4.3 Koefisien Determinasi..... | 97 |
| 4.4.4 Uji <i>Chow Test</i> | 98 |
| 4.5 Pembahasan..... | 101 |
| 4.5.1 Pembahasan Statistik Perusahaan Perbankan | 101 |
| 4.5.2 Pembahasan Statistik Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank | 105 |
| 4.5.3 Pembahasan Perbedaan Pengaruh DY, RR, EPS, Dan ROE Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Perbankan Dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB)..... | 109 |
| BAB V KESIMPULAN DAN SARAN | 110 |
| 5.1 Kesimpulan | 110 |
| 5.2 Implikasi Manajerial..... | 111 |
| 5.3 Implikasi Teoritis..... | 112 |
| 5.4 Keterbatasan Penelitian..... | 114 |
| 5.5 Agenda Penelitian Mendatang | 114 |
| DAFTAR PUSTAKA | xiii |
| LAMPIRAN | |