

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR GAMBAR.....	xvii
DAFTAR LAMPIRAN	xviii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	13
1.3.1 Tujuan Penelitian	13

1.3.2	Kegunaan Penelitian	14
1.4	Sistematika Penulisan	14
BAB II TELAAH PUSTAKA		15
2.1	Landasan Teori.....	16
2.1.1	Teori <i>Signal</i>	16
2.1.2	Saham.....	17
2.1.3	Harga Saham	19
2.1.4	Nilai Tukar	20
2.1.5	Volume Perdagangan	22
2.1.6	<i>Return On Assets (ROA)</i>	24
2.1.7	<i>Debt to Equity Ratio</i>	26
2.1.8	<i>Size</i>	28
2.2	Penelitian Terdahulu	29
2.3	Hubungan Antar Variabel	36
2.3.1	Pengaruh Nilai Tukar terhadap Harga Saham.....	36
2.3.2	Pengaruh Volume Perdagangan terhadap Harga Saham	37
2.3.3	Pengaruh ROA terhadap Harga Saham.....	38
2.3.4	Pengaruh DER terhadap Harga Saham	39
2.3.5	Pengaruh <i>Size</i> terhadap Harga Saham.....	40
2.4	Kerangka Pemikiran.....	41
2.5	Hipotesis	41

BAB III METODE PENELITIAN	43
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	43
3.1.1 Variabel Penelitian.....	43
3.1.2 Definisi Operasional Variabel.....	44
3.1.2.1 Variabel Independen	44
3.1.2.2 Variabel Dependen.....	46
3.2 Populasi dan Sampel	48
3.2.1 Populasi.....	48
3.2.2 Sampel.....	48
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	49
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	50
3.5 Metode Analisis	50
3.5.1 Uji Asumsi Klasik.....	50
3.5.1.1 Uji Normalitas.....	50
3.5.1.2 Uji Multikolinieritas.....	52
3.5.1.3 Uji Autokorelasi.....	53
3.5.1.4 Uji Heterokedastisitas	54
3.5.2 Model Regresi Berganda.....	55
3.5.3 Pengujian Hipotesis	55
3.5.3.1 Uji F.....	56
3.5.3.2 Uji Statistik t.....	57
3.5.3.3 Koefisien Determinasi (R^2).....	58

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	59
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	59
4.2 Analisis Data	59
4.2.1 Statistik Deskriptif Variabel.....	59
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	63
4.2.2.1 Uji Normalitas	64
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas	66
4.2.2.3 Uji Autokorelasi	67
4.2.2.4 Uji Heteroskedastisitas.....	69
4.2.3 Analisis Regresi	70
4.2.3.1 Uji F.....	73
4.2.3.2 Uji t.....	74
4.2.3.3 Koefisien Determinasi (R^2)	75
4.3 Pembahasan.....	76
4.3.1 Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Harga Saham	77
4.3.2 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Harga Saham	78
4.3.3 Pengaruh ROA Terhadap Harga Saham	79
4.3.4 Pengaruh DER Terhadap Harga Saham.....	79
4.3.5 Pengaruh <i>Size</i> Terhadap Harga Saham	80
BAB V PENUTUP	82
5.1 Kesimpulan	82

5.2 Keterbatasan Penelitian.....	84
5.3 Saran.....	84
DAFTAR PUSTAKA	86