

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	ii
ABSTRACT	iii
ABSTRAK	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR SINGKATAN	xiii
DAFTAR SIMBOL	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Identifikasi Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Kegunaan Hasil Penelitian	8
1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	9
1.5.1 Lokasi Penelitian.....	9
1.5.2 Waktu Penelitian.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	10
2.1 Tinjauan Pustaka	10
2.1.1 <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	10
2.1.1.1 Pengertian <i>Earning Per Share</i> (EPS).....	10
2.1.1.2 Perhitungan <i>Earning Per Share</i> (EPS)	11
2.1.2 <i>Dividend Per Share</i> (DPS).....	12
2.1.2.1 Pengertian <i>Dividend Per Share</i> (DPS).....	12
2.1.2.2 Perhitungan <i>Dividend Per Share</i> (DPS)	13
2.1.3 <i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	13

2.1.3.1	Pengertian <i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	13
2.1.3.2	Perhitungan <i>Price Earning Ratio</i> (PER).....	15
2.1.4	Saham.....	15
2.1.4.1	Pengertian Saham.....	15
2.1.4.2	Saham Syariah	16
2.1.4.3	Jenis-jenis Saham.....	17
2.1.4.4	Harga Saham.....	18
2.1.4.5	Penilaian Harga Saham	19
2.1.4.6	Analisis Penilaian Saham.....	20
2.1.5	Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	21
2.1.6	Kajian Empiris	22
2.2	Kerangka Pemikiran.....	36
2.3	Hipotesis.....	41
BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN		42
3.1	Objek Penelitian	42
3.2	Metode Penelitian.....	42
3.2.1	Jenis Penelitian	42
3.2.2	Operasionalisasi Variabel	43
3.2.3	Teknik Pengumpulan Data.....	45
3.2.3.1	Jenis dan Sumber Data.....	45
3.2.3.2	Populasi Sasaran	45
3.2.3.3	Penentuan Sampel.....	46
3.2.4	Model Penelitian.....	48
3.2.5	Teknik Analisis Data	49
3.2.5.1	Statistik Deskriptif	49
3.2.5.2	Regresi Data Panel.....	50
3.2.5.2.1	Metode Estimasi Model Regresi Data Panel.....	51
3.2.5.2.2	Pemilihan Model Regresi Data Panel	53
3.2.5.3	Uji Asumsi Klasik.....	54
3.2.5.3.1	Uji Normalitas.....	54
3.2.5.3.2	Uji Multikolinearitas.....	55

3.2.5.3.3 Uji Heteroskedastisitas.....	55
3.2.5.4 Uji Hipotesis	56
3.2.5.5 Koefisien Determinasi.....	59
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	60
4.1 Hasil Penelitian	60
4.1.1 Deskripsi Data Penelitian.....	60
4.1.1.1 <i>Earning Per Share</i> (EPS) pada Perusahaan yang Terdaftar di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2019-2023	60
4.1.1.2 <i>Dividend Per Share</i> (DPS) pada Perusahaan yang Terdaftar di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2019-2023	61
4.1.1.3 <i>Price Earning Ratio</i> (PER) pada Perusahaan yang Terdaftar di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2019-2023	63
4.1.1.4 Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di <i>Jakarta Islamic Index</i> Periode 2019-2023	64
4.1.2 Analisis Data Penelitian.....	65
4.1.2.1 Pemilihan Model Regresi Data Panel	65
4.1.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	67
4.1.2.3 Model Regresi Data Panel.....	69
4.1.2.4 Uji Hipotesis	70
4.2 Pembahasan.....	73
4.2.1 <i>Earning Per Share, Dividend Per Share, Price Earning Ratio</i> , dan Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	73
4.2.1.1 <i>Earning Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	73
4.2.1.2 <i>Dividend Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	75
4.2.1.3 <i>Price Earning Ratio</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	77
4.2.1.4 Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	79
4.2.2 Pengaruh <i>Earning Per Share, Dividend Per Share</i> , dan <i>Price Earning Ratio</i> Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	81

4.2.2.1	Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Secara Parsial Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	81
4.2.2.2	Pengaruh <i>Dividend Per Share</i> Secara Parsial Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	82
4.2.2.3	Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> Secara Parsial Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	84
4.2.2.4	Pengaruh <i>Earning Per Share</i> , <i>Dividend Per Share</i> , dan <i>Price Earning Ratio</i> Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	85
BAB V SIMPULAN DAN SARAN		87
5.1	Simpulan.....	87
5.2	Saran.....	88
DAFTAR PUSTAKA.....		90
LAMPIRAN.....		94
BIODATA PENULIS.....		112

DAFTAR TABEL

Nomor	Judul	Halaman
2.1	Persamaan dan Perbedaan Penelitian Terdahulu dengan Penelitian Penulis.....	28
3.1	Operasionalisasi Variabel.....	44
3.2	Populasi Sasaran.....	46
3.3	Proses Pengambilan Sampel Penelitian	47
3.4	Sampel Penelitian.....	48
4.1	<i>Earning Per Share</i> (EPS) pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	61
4.2	<i>Dividend Per Share</i> (DPS) pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	62
4.3	<i>Price Earning Ratio</i> (PER) pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	63
4.4	Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023.....	64
4.5	Uji <i>Chow</i>	65
4.6	Uji <i>Hausman</i>	66
4.7	Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	67
4.8	Uji Normalitas	67
4.9	Uji Multikolinearitas	68
4.10	Uji Heteroskedastisitas	69
4.11	Hasil Uji t (Parsial).....	71
4.12	Hasil Uji F (Simultan)	72
4.13	Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	72

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Judul	Halaman
1.1	Jumlah Investor di Pasar Modal Indonesia	1
1.2	Perkembangan Saham Syariah	3
1.3	Kapitalisasi Pasar <i>Jakarta Islamic Index</i>	4
2.1	Kerangka Pemikiran	40
3.1	Model Penelitian	49
4.1	Grafik <i>Earning Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	73
4.2	Rata-Rata <i>Earning Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	74
4.3	Grafik <i>Dividend Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	75
4.4	Rata-Rata <i>Dividend Per Share</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	76
4.5	Grafik <i>Price Earning Ratio</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	77
4.6	Rata-Rata <i>Price Earning Ratio</i> pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	78
4.7	Grafik Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	79
4.8	Rata-Rata Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di JII Periode 2019-2023	80

DAFTAR SINGKATAN

Nomor	Singkatan	Istilah
1	BEI	Bursa Efek Indonesia
2	BLUE	<i>Best Linear Unbiased Estimator</i>
3	CEM	<i>Common Effect Model</i>
4	DES	Daftar Efek Syariah
5	DPS	<i>Dividend Per Share</i>
6	ECM	<i>Error Component Model</i>
7	EPS	<i>Earning Per Share</i>
8	FEM	<i>Fixed Effect Model</i>
9	GLS	<i>Generalized Least Square</i>
10	JII	<i>Jakarta Islamic Index</i>
11	KSEI	Kustodian Sentral Efek Indonesia
12	LSDV	<i>Least Square Dummy Variable</i>
13	LQ45	<i>Liquid 45</i>
14	OJK	Otoritas Jasa Keuangan
15	OLS	<i>Ordinary Least Squares</i>
16	PER	<i>Price Earning Ratio</i>
17	REM	<i>Random Effect Model</i>
18	VIF	<i>Variance Inflation Factor</i>

DAFTAR SIMBOL

Nomor	Simbol	Istilah
1	----->	Pengaruh secara simultan
2	—————>	Pengaruh secara parsial
3	K	Jumlah variabel
4	N	Jumlah sampel
5	X	Variabel bebas
6	Y	Variabel terikat
7	H	Hipotesis
8	R^2	Koefisiensi determinasi
9	X_1	<i>Earning per share</i>
10	X_2	<i>Dividend Per Share</i>
11	X_3	<i>Price Earning Ratio</i>
12	Y	Harga saham
13	α	Konstanta
14	B	Koefisien Regresi
15	ε	<i>Error term</i>

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul	Halaman
1	Waktu Penelitian	95
2	Perhitungan <i>Earning Per Share</i> (dalam Rupiah)	96
3	Perhitungan <i>Dividend Per Share</i> (dalam Rupiah).....	98
4	Perhitungan <i>Price Earning Ratio</i> (dalam Rupiah)	100
5	Harga Saham (<i>Closing Price</i> (dalam Rupiah))	102
6	Uji Normalitas	104
7	Uji Multikolinearitas	104
8	Uji Heteroskedastisitas	104
9	Tabel Distribusi t.....	105
10	Tabel Distribusi F	106
11	Lembar Pengesahan Proposal Skripsi.....	107
12	Lembar Rekomendasi Penguji Seminar Proposal Skripsi (SPS).....	108
13	Lembar Revisi Seminar Proposal Skripsi (SPS)	109
14	Lembar Rekomendasi Penguji Ujian Naskah Skripsi (UNS).....	110
15	Lembar Revisi Ujian Naskah Skripsi (SPS)	111