

ABSTRACT

The objective of this study is to analyze of financial performance of companies influence that focus on Earning Per Share (EPS) of the return on company stock shares sector period 2009-2014 by Banking's company. The population become object in this research is bank's company period of year of 2009-2014. Amount sample the used is the 5 company and still stand up during period of perception and also publicized of year of 2009-2014 by BEI. The analysis method used in this research that is with linear regression analysis, hypothesis test that is determinant coefficient. The result of the study shows that earnings per share has a negative correlation to stock returns indicated that the regression coefficient is negative. The study did not prove the hypothesis H_0 means that the variable earnings per share does not affect the stock return.

Keywords: Rreturn on asset, net profit margin, earning per share, price earning ratio, and stock return

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis tentang bagaimana pengaruh kinerja keuangan perusahaan yang difokuskan pada, Earning Per Share (EPS) return saham pada perusahaan Perbankan periode 2009-2014. Populasi yang menjadi obyek dalam penelitian ini adalah Perusahaan Perbankan periode 2009-2014. Jumlah sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 5 perusahaan perbankan yang ada di Indonesia. Sampel penelitian ini diambil dengan kriteria tertentu yaitu perusahaan yang bergerak di bidang perbankan dan masih berdiri selama periode pengamatan dan dipublikasikan di BEI periode 2009-2014. Metode analisa yang digunakan dalam penelitian ini dengan analisis regresi linier, uji hipotesis yaitu koefisien determinan. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *earnings per share* memiliki hubungan negatif terhadap return saham yang ditunjukkan nilai koefisien regresi yang bertanda negatif. Hipotesis penelitian tidak terbukti artinya H_0 diterima sehingga variabel *earnings per share* tidak berpengaruh terhadap return saham.

Kata-kata kunci: Return on assets, net profit margin, earning per share, price earning ratio, dan return saham

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	iii
KATA PENGANTAR	iv
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian	4
1.4 Kegunaan Penelitian	4
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN.....	6
2.1 Kajian Pustaka	6
2.1.1 Pasar Modal	6
2.1.2 Definisi Saham	10
2.1.3 Indeks LQ45	17

2.1.4	Definisi EPS	19
2.1.5	Definisi <i>Return</i> Saham	22
2.2	Kerangka Pemikiran	24
BAB III METODE PENELITIAN		32
3.1	Jenis Penelitian.....	32
3.2	Populasi, Sampel, dan Teknik Pengambilan Sampel	32
3.3	Definisi Operasional Variabel	34
3.4	Jenis dan Sumber Data	35
3.5	Teknik Pengumpulan Data	35
3.6	Uji Asumsi Klasik	36
3.6.1	Uji Normalitas	36
3.6.2	Uji Heteroskedastisitas	37
3.6.3	Uji Autokorelasi	37
3.7	Metode Analisis Data	38
3.7.1	Analisis Regresi Linear	38
3.7.2	Koefisien Determinasi	39
3.7.3	Pengujian Hipotesis	39
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN PENELITIAN.....		41
4.1	Hasil Penelitian	41
4.1.1	Deskripsi Variabel Penelitian	42
4.1.2	Uji Asumsi Klasik	44
4.1.2.1	Uji Normalitas	44

4.1.2.2 Uji Heteroskedastisitas	45
4.1.2.3 Uji Autokorelasi	46
4.1.3 Metode Analisis Data	48
4.1.3.1 Analisis Regresi Linier	48
4.1.3.2 Uji Hipotesis Penelitian	49
4.1.3.3 Koefisien Determinasi	50
4.2 Pembahasan	51
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	52
5.1 Simpulan	52
5.2 Keterbatasan.....	52
5.3 Saran	53
DAFTAR PUSTAKA	54
LAMPIRAN	56
DAFTAR RIWAYAT HIDUP PENULIS (<i>CURRICULUM VITAE</i>).....	60

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 4.1 Hasil Uji Heteroskedastisitas	46

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu 27
Tabel 3.1	Sampel Penelitian Perusahaan Perbankan 33
Tabel 3.2	Operasional Variabel Penelitian 34
Tabel 4.1	Data Variabel Penelitian 42
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif 43
Tabel 4.3	Hasil Uji Normalitas 45
Tabel 4.4	Hasil Uji Autokorelasi 47
Tabel 4.5	Hasil Analisis Regresi Linier 48
Tabel 4.6	Hasil Koefisien Determinasi 50

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran A	Statistik Deskriptif 56
Lampiran B	Uji Asumsi Klasik Normalitas 56
Lampiran C	Uji Heteroskedastisitas 57
Lampiran D	Uji Autokorelasi 57
Lampiran E	Uji Regresi 58