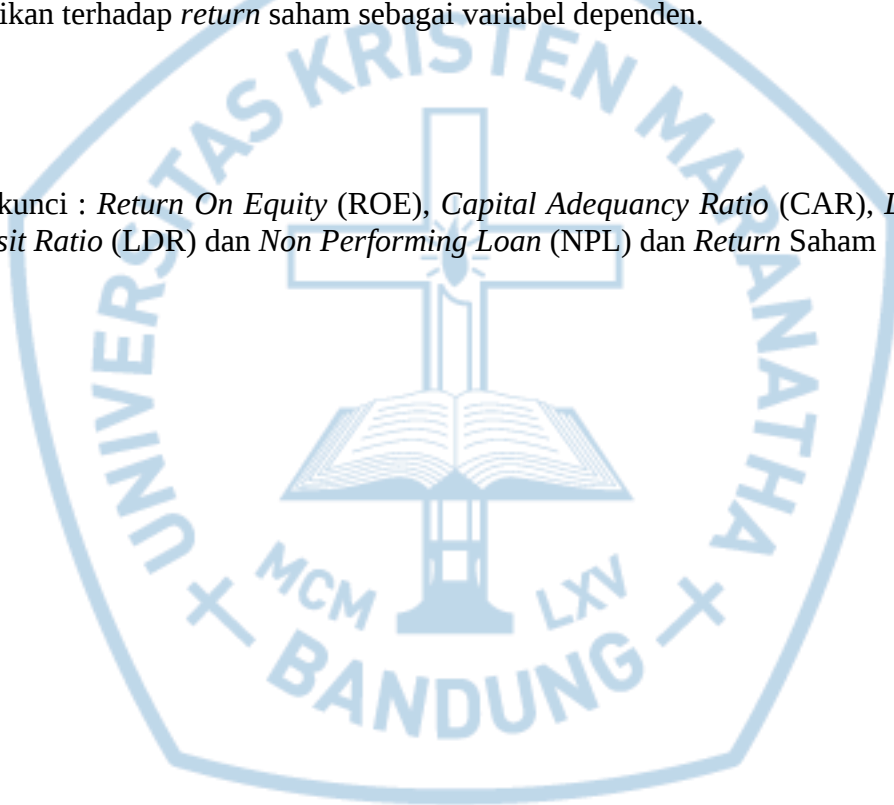


Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Loan to Deposit Ratio* (LDR) dan *Non Performing Loan* (NPL) terhadap *Return Saham* Perusahaan Perbankan. Jumlah sampel dalam penelitian ini adalah 4 perusahaan perbankan yang masuk ke dalam LQ-45 pada periode 2010-2014. Metode statistika yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linier berganda dan uji hipotesis yang menggunakan uji t, uji f dan analisis koefisien determinasi. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial dan secara simultan variabel ROE, CAR, LDR dan NPL sebagai variabel independen tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham sebagai variabel dependen.

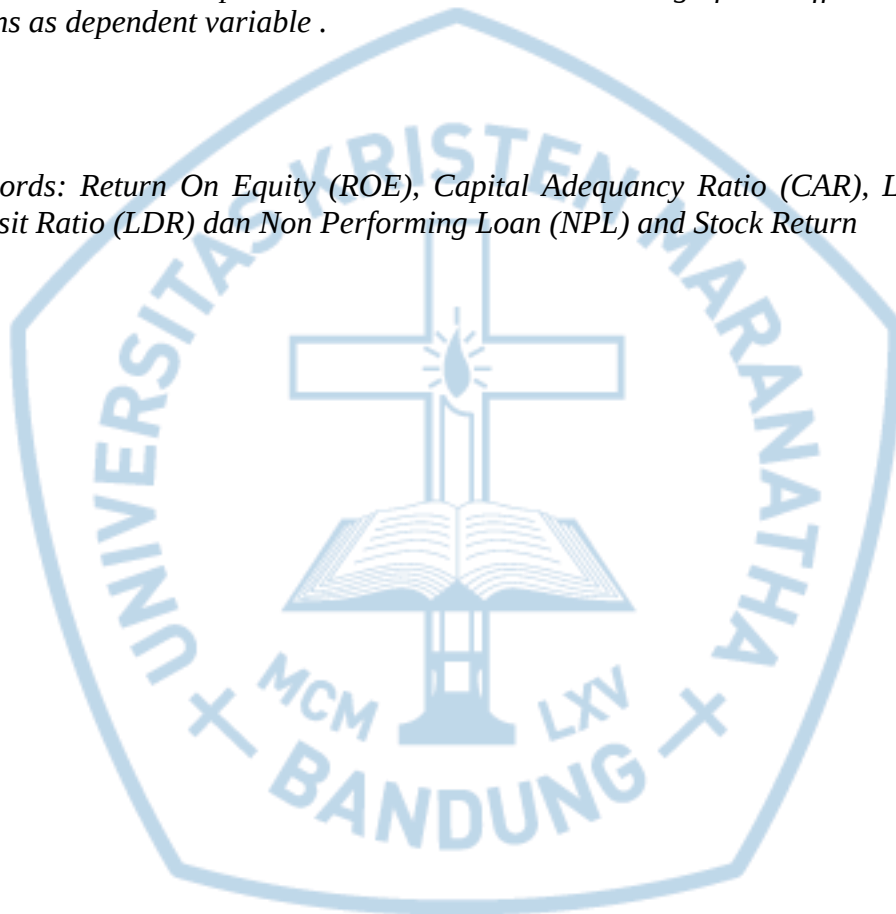
Kata kunci : *Return On Equity* (ROE), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Loan to Deposit Ratio* (LDR) dan *Non Performing Loan* (NPL) dan *Return Saham*



Abstarct

This study aims to examine and analyze the effect of Return On Equity (ROE) , Capital Adequacy Ratio (CAR) , Loan to Deposit Ratio (LDR) and Non Performing Loan (NPL) of the Stock Returns banking company . The number of samples in this study were four banking companies enter into LQ 45 in the period 2010-2014. Statistical methods used in this research is multiple linear regression analysis and hypothesis testing using t-test, f and the coefficient of determination . The results of this study showed that partially and simultaneously ROE , CAR , LDR and NPL as independent variables do not have a significant effect on stock returns as dependent variable .

Keywords: Return On Equity (ROE), Capital Adequacy Ratio (CAR), Loan to Deposit Ratio (LDR) dan Non Performing Loan (NPL) and Stock Return



DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN TUGAS AKHIR	iii
PERNYATAAN PUBLIKASI LAPORAN PENELITIAN	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
 BAB I PENDAHULUAN	 1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	7
 BAB II LANDASAN TEORI	 9
2.1 Kajian Pustaka	9
2.1.1 Pasar Modal	9
2.1.1.1 Pengertian.....	9
2.1.1.2 Instrumen Pasar Modal	10
2.1.2 Saham.....	11
2.1.2.1 Pengertian.....	11
2.1.2.2 Jenis-jenis Saham	11
2.1.3 <i>Return Saham</i>	13
2.1.4 Laporan Keuangan Bank.....	14
2.1.4.1 Pengertian	14
2.1.4.2 Tujuan	15
2.1.4.3 Jenis-jenis Laporan Keuangan	16
2.1.5 Analisis Rasio	17
2.1.5.1 <i>Return On Equity (ROE)</i>	18
2.1.5.2 <i>Capital Adequacy Ratio (CAR)</i>	19
2.1.5.3 <i>Loan to Deposit Ratio (LDR)</i>	20
2.1.5.4 <i>Non Performing Loan (NPL)</i>	21
2.1.6 Penelitian Terdahulu	22

2.1.7 Rerangka Teori.....	26
2.2 Rerangka Pemikiran	27
2.3 Metode Penelitian	28
2.4 Pengembangan Hipotesis.....	29
BAB III METODE PENELITIAN.....	30
3.1 Jenis Penelitian	30
3.2 Populasi, Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel	31
3.2.1 Populasi.....	31
3.2.2 Sampel.....	31
3.2.3 Teknik Pengambilan Sampel	32
3.3 Definisi Operasional Variabel	32
3.3.1 Variabel Dependen.....	32
3.3.2 Variabel Independen	33
3.3.3 Definisi Operasional	33
3.4 Teknik Pengumpulan Data	36
3.5 Metode Analisis Data	37
3.5.1 Teknik Analisis Data.....	37
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	38
3.5.2.1 Uji Normalitas	38
3.5.2.2 Uji Multikolinearitas	39
3.5.2.3 Uji Heteroskedastisitas.....	39
3.5.2.4 Uji Autokorelasi	40
3.5.3 Uji Hipotesis	40
3.5.3.1 Uji t (Uji Parsial).....	40
3.5.3.2 Uji F (Uji Simultan)	41
3.5.3.3 Koefisien Determinasi.....	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	43
4.1 Hasil Penelitian.....	43
4.1.1 Variabel Data Penelitian	43
4.1.2 Uji Asumsi Klasik.....	46
4.1.2.1 Uji Normalitas	47
4.1.2.2 Uji Multikolinearitas	48
4.1.2.3 Uji Heteroskedastisitas.....	50
4.1.2.4 Uji Autokorelasi	51
4.1.3 Teknik Analisis Data.....	52
4.1.4 Uji Hipotesis	54
4.1.4.1 Uji t	54
4.1.4.2 Uji F	56
4.1.4.3 Analsis Koefisien Determinasi.....	57
4.2 Pembahasan	58

4.2.1 <i>Return On Equity</i> (ROE) terhadap <i>Return Saham</i>	58
4.2.2 <i>Capital Adequancy Ratio</i> (CAR) terhadap <i>Return Saham</i>	59
4.2.3 <i>Loan to Deposit Ratio</i> (LDR) terhadap <i>Return Saham</i>	59
4.2.4 <i>Non Performing Loan</i> (NPL) terhadap <i>Return Saham</i>	60
4.2.5 Pembahasan Uji Simultan (Uji F)	61
4.3 Perbandingan dengan Hasil Riset Empiris	62
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	63
5.1 Kesimpulan	63
5.2 Saran	65
5.3 Keterbatasan Penelitian	66
 DAFTAR PUSTAKA	67
LAMPIRAN.....	70
DAFTAR RIWAYAT HIDUP PENULIS (<i>CURRICULUM VITAE</i>).....	95



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1	Rerangka Teori 26
Gambar 2.2	Rerangka Pemikiran 27
Gambar 2.3	Metode Penelitian..... 28



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu.....22
Tabel 3.1	Sampel Penelitian32
Tabel 3.2	DOV34
Tabel 4.1	Data ROE, LDR, CAR dan NPL Perbankan yang masuk LQ-45 di BEI 2010-201444
Tabel 4.2	Hasil Uji Normalitas.....47
Tabel 4.3	Uji Multikolinearitas49
Tabel 4.4	Hasil Uji Multikolinearitas49
Tabel 4.5	Uji Heteroskedastisitas50
Tabel 4.6	Uji Autokorelasi52
Tabel 4.7	Hasil Regresi Linear Berganda.....53
Tabel 4.8	Uji t.....55
Tabel 4.9	Uji F.....57
Tabel 4.10	Hasil Pengaruh Simultan58
Tabel 4.11	Perbandingan dengan Hasil Riset Empiris62

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
LAMPIRAN A	Daftar Ikhtisar Keuangan Perusahaan-Perusahaan Sampel Periode 2010-2014 71
LAMPIRAN B	Daftar <i>Return</i> Saham Perusahaan-Perusahaan Sampel Periode 2010-2014 91
LAMPIRAN C	Hasil <i>Output</i> SPSS 92

