

DAFTAR ISI

| | |
|------------------------------------|------|
| LEMBAR JUDUL..... | i |
| LEMBAR PENGESAHAN..... | ii |
| LEMBAR PERNYATAAN | iii |
| KATA PENGANTAR | iv |
| DAFTAR ISI..... | vvi |
| DAFTAR TABEL..... | ix |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | xxi |
| ABSTRAK | xiii |
| ABSTRACT | xiii |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang Masalah | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 5 |
| 1.3 Pertanyaan Penelitian | 6 |
| 1.4 Tujuan Penelitian..... | 6 |
| 1.5 Manfaat Penelitian..... | 7 |
| 1.6 Ruang Lingkup Penelitian | 7 |
| 1.7 Ruang Lingkup Penelitian | 8 |
| BAB II LANDASAN TEORI..... | 9 |
| 2.1 Saham | 9 |
| 2.1.1 Pengertian Saham | 9 |
| 2.1.2 Pengertian Harga Saham..... | 9 |
| 2.1.3 <i>Return saham</i> | 10 |
| 2.1.4 Jenis Harga Saham..... | 11 |
| 2.2 Bank..... | 13 |
| 2.2.1 Pengertian Bank | 13 |
| 2.2.2 Jenis-jenis Bank | 14 |

| | |
|--|-----------|
| 2.2.3 Fungsi Bank | 16 |
| 2.3 Kesehatan Perbankan | 18 |
| 2.3.1 Pengertian Kesehatan Perbankan | 18 |
| 2.3.2 Mekanisme Penilaian Tingkat Kesehatan Perbankan | 19 |
| 2.3.3 Peringkat Komposit Tingkat Kesehatan Perbankan | 21 |
| 2.3.4 Tindak Lanjut Hasil Penilaian Tingkat Kesehatan Perbankan | 24 |
| 2.4 Kajian Penelitian Terdahulu | 25 |
| 2.5 Kerangka Penelitian | 27 |
| 2.6 Pengembangan Hipotesis | 28 |
| 2.6.1 Pengaruh Resiko Profil (LDR) Terhadap <i>Return Saham</i> | 28 |
| 2.6.2 Pengaruh Tata Kelola Perusahaan Terhadap <i>Return Saham</i> | 30 |
| 2.6.3 Pengaruh Profitabilitas Terhadap <i>Return Saham</i> | 32 |
| 2.6.4 Pengaruh Permodalan Terhadap <i>Return Saham</i> | 33 |
| BAB III METODA PENELITIAN | 36 |
| 3.1 Metoda Penelitian..... | 36 |
| 3.2 Objek Penelitian | 36 |
| 3.3 Jenis Data | 36 |
| 3.4 Populasi dan Sampel | 37 |
| 3.5 Teknik Pengumpulan Data | 37 |
| 3.6 Definisi Operasional Variabel Penelitian | 38 |
| 3.7 Metode Analisis Penelitian..... | 43 |
| 3.7.1 Analisis Statistik Deskriptif | 43 |
| 3.7.2 Regresi Berganda Model Panel Data | 44 |
| 3.7.3 Memilih Model Regresi Data Panel..... | 46 |
| 3.7.4 Uji Asumsi Klasik..... | 48 |
| 3.7.5 Uji Hipotesis | 51 |
| BAB IV PEMBAHASAN DAN ANALISA | 53 |
| 4.1 Penjelasan Deskriptif Objek Penelitian | 53 |
| 4.1.1 Analisis Statistik Deskriptif | 54 |
| 4.1.2 Estimasi Pemilihan Model | 58 |

| | |
|--|------------|
| 4.1.3 Uji Asumsi Klasik..... | 64 |
| 4.1.4 Pengujian Hipotesis | 67 |
| BAB V KESIMPULAN DAN SARAN..... | 77 |
| 5.1 Kesimpulan..... | 77 |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian | 78 |
| 5.3 Saran | 79 |
| 5.4 Implikasi penelitian | 79 |
| DAFTAR PUSTAKA..... | xiv |

DAFTAR TABEL

| | |
|---|----|
| Tabel 3.1 Kriteria Penilaian Peringkat (LDR)..... | 39 |
| Tabel 3.2 Matriks Perhitungan/Analisis Komponen Faktor Manajemen..... | 40 |
| Tabel 3.3 Kriteria Penilaian Peringkat (ROA)..... | 42 |
| Tabel 3.4 Kriteria Penilaian Peringkat (CAR)..... | 43 |
| Tabel 4.1 Rincian Pemilihan Sampel..... | 53 |
| Tabel 4.2 Hasil Analisis Statistik Deskriptif..... | 54 |
| Tabel 4.3 Hasil Estimasi Pemilihan Model..... | 60 |
| Tabel 4.4 Hasil Uji Chow..... | 61 |
| Tabel 4.5 Hasil Uji Hausman..... | 62 |
| Tabel 4.6 Hasil Uji Lagrange Multiplier (LM)..... | 63 |
| Tabel 4.7 Hasil Uji Multikolinearitas..... | 65 |
| Tabel 4.8 Hasil Uji Heteroskedastisitas..... | 65 |
| Tabel 4.9 Hasil Uji Autokorelasi – Durbin Watson..... | 66 |
| Tabel 4.10 Hasil Analisis Regresi Berganda..... | 67 |
| Tabel 4.11 Hasil Uji t..... | 69 |
| Tabel 5.1 Ringkasan Hasil Penelitian..... | 77 |

DAFTAR GAMBAR

| | |
|--|----|
| Gambar 2.1 Kerangka Pikir Peneliti..... | 35 |
| Gambar 4.1 Histogram Uji Normalitas..... | 64 |

DAFTAR LAMPIRAN

| | |
|--|----|
| Lampiran I Daftar Bank..... | 1 |
| Lampiran II Hasil Analisis Statistik Deskriptif..... | 15 |
| Lampiran III Hasil Uji Common Effect Model..... | 16 |
| Lampiran IV Hasil Uji Fixed Effect Model..... | 17 |
| Lampiran V Hasil Uji Random Effect Model..... | 18 |
| Lampiran VI Hasil Uji Chow..... | 20 |
| Lampiran VII Hasil Uji Hausman..... | 21 |
| Lampiran VIII Hasil Uji Lagrange Multiplier..... | 22 |
| Lampiran IX Hasil Uji Normalitas..... | 23 |
| Lampiran X Hasil Uji Multikolinearitas..... | 24 |
| Lampiran XI Hasil Uji Heteroskedastisitas..... | 25 |
| Lampiran XII Hasil Uji Autokorelasi..... | 26 |