

## DAFTAR ISI

<b>ABSTRACT .....</b>	<b>i</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>ii</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Identifikasi, Perumusan dan Batasan Masalah .....	8
1.2.1 Identifikasi Masalah .....	8
1.2.2 Rumusan Masalah .....	8
1.2.3 Batasan Masalah.....	10
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian .....	10
1.3.1 Maksud Penelitian .....	10
1.3.2 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Manfaat Penelitian dan Kegunaan Penelitian.....	12
1.4.1 Manfaat Penelitian.....	12
1.4.2 Kegunaan Penelitian.....	13

<b>BAB II DESKRIPSI OBJEK PENELITIAN .....</b>	<b>14</b>
2.1 Sejarah Singkat.....	14
2.1.1 Sejarah Bursa Efek Indonesia .....	14
2.2 Lingkup Bidang Usaha.....	18
2.3 Tantangan Bisnis Perbankan .....	21
2.4 Kategori Bank .....	23
2.5 Azas dan Prinsip Perbankan.....	28
2.6 Pasar Modal.....	31
2.7 Bursa Efek .....	32
2.8 Mekanisme Perdagangan Saham.....	33
<b>BAB III KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS .....</b>	<b>37</b>
3.1 Kajian Teori.....	37
3.1.1 Teori <i>Signalling</i> .....	37
3.1.2 Hipotesa Pasar Efisien.....	39
3.1.3 Saham.....	40
3.1.4 <i>Return Saham</i> .....	41
3.1.5 Bank .....	44
3.1.6 Penilaian Kesehatan Bank.....	46
3.1.7 Analisis <i>Risk Profile, Good Corporate Governance, Earning and Capital</i> .....	50
3.2 Penelitian Terdahulu .....	58
3.3 Kerangka Pemikiran.....	60
3.4 Hipotesis.....	61

<b>BAB IV METODE PENELITIAN .....</b>	<b>63</b>
4.1 Jenis Penelitian .....	63
4.2 Variabel Penelitian .....	63
4.2.1 <i>Risk Profile</i> .....	63
4.2.2 <i>Good Corporate Governance</i> .....	65
4.2.3 <i>Earning</i> .....	65
4.2.4 <i>Capital</i> .....	68
4.2.5 <i>Return Saham</i> .....	68
4.3 Populasi dan Sampel Penelitian .....	69
4.4 Jenis dan Sumber Data .....	71
4.5 Tehnik Pengumpulan Data .....	71
4.6 Metode Analisa Data .....	71
4.6.1 Analisis Statistik Data Panel .....	72
4.6.1.1 Metode Kuadrat Terkecil ( <i>Pooled Least Square</i> ) .....	73
4.6.1.2 Metode Efek Tetap ( <i>Fixed Effect</i> ) .....	74
4.6.1.3 Metode Efek Acak ( <i>Random Effect</i> ) .....	75
4.6.1.4 Pengujian Model Data Panel .....	76
4.6.2 Uji Asumsi Klasik .....	79
4.6.2.1 Uji Normalitas .....	80
4.6.2.2 Uji Multikolinearitas .....	81
4.6.2.3 Uji Heterokedasitas .....	82
4.6.2.4 Uji Autokorelasi .....	82
4.6.2.5 Analisis Linier Berganda .....	84

4.6.2.6 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F) .....	85
4.6.2.7 Uji Signifikansi Parsial (Uji $-t$ ) .....	86
4.6.2.8 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	86
<b>BAB V PEMBAHASAN .....</b>	<b>88</b>
5.1 Deskripsi Data Penelitian .....	88
5.2 Analisis Data .....	91
5.2.1 Uji Chow .....	92
5.2.2 Uji Hausman .....	93
5.2.3 Uji Asumsi Klasik .....	94
5.2.3.1 Uji Normalitas .....	94
5.2.3.2 Uji Multikolinieritas .....	95
5.2.3.3 Uji Heterokedasitas .....	96
5.2.3.4 Uji Autokorelasi .....	98
5.2.4 Perumusan Model Regresi .....	99
5.2.5 Uji F Statistik .....	102
5.2.6 Uji t Statisik .....	103
5.2.7 Koefisien Determinasi .....	104
5.3 Interpretasi Hasil Penelitian .....	104
5.3.1 Pengaruh NPL terhadap <i>Return Saham</i> .....	104
5.3.2 Pengaruh LDR terhadap <i>Return Saham</i> .....	106
5.3.3 Pengaruh GCG terhadap <i>Return Saham</i> .....	107
5.3.4 Pengaruh ROA terhadap <i>Return Saham</i> .....	107
5.3.5 Pengaruh NIM terhadap <i>Return Saham</i> .....	108
5.3.6 Pengaruh BOPO terhadap <i>Return Saham</i> .....	109
5.3.7 Pengaruh CAR terhadap <i>Return Saham</i> .....	110

<b>BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>112</b>
6.1 Kesimpulan .....	112
6.2 Saran .....	113
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>115</b>
<b>LAMPIRAN .....</b>	<b>122</b>
<b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP .....</b>	<b>134</b>



U N I V E R S I T A S  
M E R C U B U A N A