

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
ABSTRACT.....	iv
ABSTRAK.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	12
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	13
1. Tujuan Penelitian	13
2. Kontribusi Penelitian.....	14
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka.....	15
1. Teori Signal.....	15
2. Saham.....	17

a. Pengertian Saham.....	17
b. Jenis –Jenis Saham.....	18
3. Return Saham.....	20
a. Komponen Return Saham.....	21
b. Jenis - Jenis Return Saham.....	22
c. Faktor yang Mempengaruhi Return Saham.....	24
4. Bank.....	25
a. Jenis Bank Berdasarkan Fungsi.....	26
b. Fungsi Bank.....	27
5. Metode RGEC.....	28
6. Profil Risiko (<i>Risk Profile</i>).....	30
a. Risiko Kredit (<i>Credit Risk</i>).....	31
b. Risiko Likuiditas.....	33
7. Good Corporate Governance.....	37
8. Rentabilitas.....	43
a. <i>Net Interest Margin</i>	44
9. Permodalan.....	45
a. <i>Capital Adequacy Ratio</i>	45
10. Penelitian Terdahulu.....	47
B. Rerangka Pemikiran.....	59
C. Hipotesis.....	59
 BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	61

B. Desain Penelitian.....	61
C. Definisi dan Operasional Variabel.....	62
1. Variabel Dependen.....	62
2. Variabel Independen.....	63
a. <i>Loan Deposit Ratio</i> (LDR).....	64
b. <i>Non Performing Loan</i> (NPL).....	65
c. <i>Good Corporate Governance</i> (GCG).....	65
d. <i>Net Interest Margin</i> (NIM).....	66
e. <i>Capital Adequacy Ratio</i> (CAR).....	67
D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	70
1. Populasi Penelitian.....	70
2. Sampel Penelitian.....	71
E. Teknik Pengumpulan Data.....	72
F. Metode Analisis Data.....	73
1. Uji Statistik Deskriptif.....	74
2. Uji Asumsi Klasik.....	74
a. Uji Normalitas.....	74
b. Uji Autokorelasi.....	75
c. Uji Heterokedastisitas.....	76
d. Uji Multikolinieritas.....	77
3. Uji Hipotesis.....	78
a. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	78
b. Uji Signifikansi (Uji Statistik F).....	79

c. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t).....	80
d. Uji Analisis Regresi Linier Berganda.....	80

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	82
B. Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	82
C. Hasil Uji Asumsi Klasik.....	85
1. Hasil Uji Normalitas.....	85
2. Hasil Uji Multikolinieritas.....	87
3. Hasil Uji Heterokedastisitas.....	88
4. Hasil Uji Autokorelasi.....	90
D. Hasil Uji Hipotesis.....	91
1. Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	91
2. Hasil Uji F.....	92
3. Hasil Uji t.....	93
4. Hasil Uji Analisis Regresi Linier Berganda.....	95
E. Pembahasan Hasil Penelitian	99
1. Pengaruh <i>Loan Deposit Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	99
2. Pengaruh <i>Non Performing Loan</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	100
3. Pengaruh Good Corporate Governance Terhadap <i>Return Saham</i>	101
4. Pengaruh <i>Net Interest Margin</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	102
5. Pengaruh <i>Capital Adequacy Ratio</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	103

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan.....104

B. Saran.....105

DAFTAR PUSTAKA.....107

LAMPIRAN111

