

**PENGARUH KINERJA PERBANKAN TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA
PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA**

***THE INFLUENCE OF BANKING PERFORMANCE ON STOCK RETURNS ON
COMPANIES LISTED ON THE INDONESIAN STOCK EXCHANGE***

SKRIPSI

Diajukan Guna Memenuhi Persyaratan untuk Memperoleh Gelar Sarjana pada
Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Program Studi Manajemen
Universitas Muhammadiyah Yogyakarta



Oleh
TOMI NEPI ANGGORO
20140410383

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH YOGYAKARTA
2018

PERNYATAAN

Dengan ini saya,

Nama : Tomi Nepi Anggoro

Nomor Mahasiswa : 20140410383

Menyatakan bahwa skripsi ini dengan judul: **“PENGARUH KINERJA PERBANKAN TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA”** tidak terdapat karya yang pernah diajukan untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu perguruan tinggi, dan sepanjang pengetahuan saya juga tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang secara tertulis diacu dalam naskah ini dan disebutkan dalam Daftar Pustaka. Apabila ternyata dalam skripsi ini diketahui terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain maka saya bersedia karya tersebut dibatalkan.

Yogyakarta, 9 Maret 2018



Tomi Nepi Anggoro

MOTTO DAN PERSEMBAHAN

Usaha, usaha, usaha dulu

Setiap usaha tidak akan pernah sia-sia

Meskipun tak membuahkan hasil

Usaha tetap akan menggoreskan tintanya pada sebuah proses

Bahkan,

Segagal-gagalnya usaha tetaplah lebih baik daripada gagal yang tanpa usaha.

Sebuah persembahan untuk seluruh orang-orang disekitarku

Karena setiap individu memiliki porsinya masing-masing

Keluarga, kerabat, sahabat

se-angkatan, se-jurusan, se-universitas, se-perantauan, se-perjuangan

Kasih, Ilmu, wawasan, cerita, canda, dan pengalaman

Memberi suka untuk bahagia dan duka untuk lebih kuat

Membentuk fisik dan mental ini berada pada titik sekarang

Terimakasih untuk segalanya

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kehadiran Allah SWT yang telah memberikan Rahmat dan Hidayah-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi dengan judul “Pengaruh Kinerja Perbankan Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia”.

Skripsi ini disusun untuk memenuhi salah satu persyaratan dalam memperoleh gelar Sarjana pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Yogyakarta. Penulis mengambil topik ini dengan harapan dapat memberikan masukan bagi organisasi dalam penggunaan taktik mempengaruhi dalam pengambilan keputusan organisasional dan memberikan ide pengembangan bagi penelitian selanjutnya

Dalam menyelesaikan skripsi ini, penulis mendapatkan bimbingan dari berbagai pihak, oleh karena itu penulis mengucapkan terima kasih yang sebanyak-banyaknya kepada:

1. Ibu Lela Hindasah, SE., M.Si. selaku dosen pembimbing skripsi yang dengan sabar telah memberikan masukan dan bimbingan selama proses penyelesaian karya tulis ini.
2. Ayah dan Ibu serta saudara-saudaraku yang senantiasa memberi dorongan dan motivasi serta perhatian kepada penulis hingga dapat menyelesaikan studi.

3. Teman – teman yang telah memberikan masukan, ilmu dan wawasan, dan pengalaman dalam rangka penulisan karya tulis sehingga penulis mendapatkan lebih banyak referensi.
4. Dan seluruh pihak yang telah memberikan dukungan, bantuan, kemudahan dan semangat dalam proses penyelesaian karya tulis ini, yang mana tak dapat penulis sebutkan satu per satu.

Penulis menyadari bahwa laporan ini masih jauh dari sempurna. Oleh karena itu kritik dan saran yang sifatnya membangun sangat penulis harapkan demi pengembangan penelitian selanjutnya sangat diperlukan untuk kedalaman karya tulis dengan topik ini.

Yogyakarta, 9 Maret 2018

Tomii Nepi Anggoro

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN.....	v
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	vi
INTISARI.....	vii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
BAB I.....	1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Batasan Masalah Penelitian.....	8
C. Rumusan Masalah Penelitian.....	8
D. Tujuan Penelitian.....	9
E. Manfaat Penelitian.....	10
BAB II.....	11
A. Landasan Teori.....	11
1. Saham.....	11
2. Return Saham.....	12
3. Bank.....	13
4. Kinerja Bank.....	14
5. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	19
B. Hasil Penelitian Terdahulu.....	21
C. Penurunan Hipotesis.....	23
D. Model Penelitian.....	27

BAB III.....	28
A. Obyek Penelitian	28
B. Populasi	28
C. Jenis Data.....	28
D. Teknik Pengambilan Sampel.....	28
E. Pengumpulan Data.....	29
F. Definisi Operasional Variabel.....	29
1. Variabel Dependen.....	30
2. Variabel Independen	30
G. Analisis Data	32
1. Analisis Statistik Deskriptif.....	32
2. Analisis Regresi Berganda	33
3. Uji Asumsi Klasik.....	34
4. Uji Hipotesis	37
BAB IV	39
A. Gambaran Umum Obyek Penelitian.....	39
B. Uji Kualitas Instrumen dan Data	40
1. Analisis Statistik Deskriptif.....	40
2. Uji Asumsi Klasik.....	42
3. Analisis Regresi Berganda	45
C. Uji F	48
D. Pengujian Hipotesis (Uji t)	49
E. Pengujian Model Regresi dengan Koefisien Determinasi / R^2	51
F. Pembahasan (Interpretasi)	52
BAB V.....	57
A. Kesimpulan.....	57

B. Saran	58
C. Keterbatasan Penelitian	59
DAFTAR PUSTAKA	60
LAMPIRAN	63

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Klasifikasi Peringkat Komposit NPL.....	16
Tabel 2. 2 Klasifikasi Peringkat Komposit LDR	17
Tabel 2. 3 Klasifikasi Peringkat GCG.....	18
Tabel 3. 1 Tabel Pengambilan Keputusan Uji Autokorelasi.....	366

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 IHSG dan Pergerakan Indeks Sektoral.....	2
Gambar 2. 1 Model Penelitian.....	27