

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
SURAT PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2 Identifikasi Masalah	6
1.3 Pembatasan Masalah	6
1.4 Rumusan Masalah	7
1.5 Maksud dan Tujuan Penelitian	7
1.5.1 Maksud Penelitian.....	7
1.5.2 Tujuan Penelitian.....	8
1.6 Kegunaan Penelitian.....	8
1.7 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	10
1.7.1 Lokasi Penelitian.....	10
1.7.2 Waktu Penelitian	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Teori dan Konsep	12

2.1.1	Manajemen.....	12
2.1.2	Manajemen Keuangan.....	13
2.1.3	Investasi.....	16
2.1.4	Pasar Modal.....	20
2.1.5	Saham.....	23
2.1.6	<i>Return Saham</i>	27
2.1.7	Tingkat Kesehatan Bank.....	29
2.2	Kerangka Pemikiran dan Hipotesis.....	35
2.2.1	Kerangka Pemikiran.....	35
2.2.2	Hipotesis.....	38
BAB III METODE PENELITIAN.....		39
3.1	Objek Penelitian.....	39
3.2	Desain Penelitian.....	39
3.3	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	41
3.4	Populasi dan Sampel Penelitian.....	44
3.4.1	Populasi Penelitian.....	44
3.4.2	Sampel Penelitian.....	46
3.5	Teknik Pengumpulan Data dan Instrumen Penelitian.....	48
3.5.1	Teknik Pengumpulan Data.....	48
3.5.2	Instrumen Penelitian.....	49
3.6	Teknik Analisis Data.....	50
3.6.1	Analisis Deskriptif.....	50
3.6.2	Analisis Asosiatif.....	51
3.6.3	Uji Asumsi Klasik.....	56
3.6.4	Pengujian Hipotesis.....	60

BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	64
4.1	Hasil Penelitian.....	64
4.1.1	Deskripsi Data Penelitian.....	64
4.1.2	Analisis Deskriptif.....	65
4.1.3	Analisis Asosiatif	85
4.1.4	Uji Asumsi Klasik	90
4.1.5	Pengujian Hipotesis.....	95
4.2	Pembahasan Hasil Penelitian.....	98
4.2.1	Pengaruh Tingkat Kesehatan Bank Terhadap <i>Return</i> Saham	98
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	105
5.1	Kesimpulan.....	105
5.2	Saran	106
DAFTAR PUSTAKA		108

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Jadwal Kegiatan Penelitian Skripsi
Tabel 2.1	Studi Empiris
Tabel 3.1	Desain Penelitian
Tabel 3.2	Operasionalisasi Variabel
Tabel 3.3	Daftar Emiten Sektor <i>Finance</i> yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Indeks Papan Utama dan Indeks Papan Pengembangan
Tabel 3.4	Sampel Penelitian
Tabel 4.1	Tabel Nama Bank BUMN yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia
Tabel 4.2	Perkembangan Tingkat Kesehatan Bank BNI
Tabel 4.3	Perkembangan Tingkat Kesehatan Bank BRI
Tabel 4.4	Perkembangan Tingkat Kesehatan Bank BTN
Tabel 4.5	Perkembangan Tingkat Kesehatan Bank Mandiri
Tabel 4.6	Perkembangan <i>Return</i> Saham pada Bank BUMN
Tabel 4.7	Hasil Analisis Regresi Data Panel – <i>Common Effect Model</i>
Tabel 4.8	Hasil Analisis Regresi Data Panel – <i>Fixed Effect Model</i>
Tabel 4.9	Hasil Uji F-Chow
Tabel 4.10	Hasil Uji Autokorelasi dengan Metode Durbin Watson (D-W)
Tabel 4.11	Matrik Korelasi Variabel Bebas
Tabel 4.12	Hasil Uji Heteroskedastisitas
Tabel 4.13	Hasil Pengujian Hipotesis – Uji t (Uji Regresi Secara Parsial)
Tabel 4.14	Hasil Perbandingan t_{tabel} dengan t_{hitung}
Tabel 4.15	Hasil Pengujian Hipotesis – Uji F (Uji Regresi Secara Simultan)
Tabel 4.16	Hasil Pengujian Hipotesis – Koefisien Determinasi

DAFTAR GAMBAR

- Grafik 1.1 Grafik Pergerakan Harga Saham Bank BUMN Periode 2009-2018
- Grafik 1.2 Grafik Pergerakan Inflasi
- Grafik 1.3 Grafik Perbandingan Harga Saham Bank BUMN dengan Tingkat Inflasi Periode 2009-2018
- Grafik 4.1 Grafik Uji Normalitas
- Gambar 2.1 Paradigma Penelitian
- Gambar 3.1 Daerah Penentuan H_0 pada Uji t
- Gambar 3.2 Daerah Penentuan H_0 pada Uji F
- Gambar 3.3 Kriteria Pengujian Autokorelasi

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Surat Keterangan Penelitian dari PT Bursa Efek Indonesia Kantor Perwakilan Jawa Barat
- Lampiran 2 Tanda Terima Data Penelitian dari PT Bursa Efek Indonesia Kantor Perwakilan Jawa Barat
- Lampiran 3 Berita Acara Bimbingan Skripsi
- Lampiran 4 Hasil Analisis Deskriptif Tingkat Kesehatan Bank BNI
- Lampiran 5 Hasil Analisis Deskriptif Tingkat Kesehatan Bank BRI
- Lampiran 6 Hasil Analisis Deskriptif Tingkat Kesehatan Bank BTN
- Lampiran 7 Hasil Analisis Deskriptif Tingkat Kesehatan Bank Mandiri
- Lampiran 8 Hasil Analisis Deskriptif Tingkat Kesehatan Bank BUMN
- Lampiran 9 Hasil Analisis Deskriptif *Return* Saham Bank BUMN
- Lampiran 10 Tabulasi Data Panel
- Lampiran 11 Hasil Analisis Regresi Data Panel – *Common Effect Model*
- Lampiran 12 Hasil Analisis Regresi Data Panel – *Fixed Effect Model*
- Lampiran 13 Hasil Uji F-Chow
- Lampiran 14 Hasil Uji Asumsi – Uji Normalitas
- Lampiran 15 Hasil Uji Asumsi – Uji Autokorelasi
- Lampiran 16 Hasil Uji Asumsi – Uji Multikolinearitas
- Lampiran 17 Hasil Uji Asumsi – Uji Heteroskedastisitas
- Lampiran 18 Hasil Uji Hipotesis – Uji t (Uji parsial)
- Lampiran 19 Hasil Uji Hipotesis – Perbandingan t_{tabel} dengan t_{hitung}
- Lampiran 20 Hasil Uji Hipotesis – Uji F (Uji simultan)
- Lampiran 21 Hasil Uji Hipotesis – Koefisien Determinasi
- Lampiran 22 Harga Saham Bank BUMN Periode 2009-2018
- Lampiran 23 Tingkat Inflasi Periode 2009-2018