

PENGARUH RETURN ON EQUITY (ROE), BOOK VALUE PER SHARE (BVPS), DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN SEKTOR PERTAMBANGAN BATUBARA PADA BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2013-2018.

**JEFRI
8215161588**



Skripsi ini Disusun Sebagai Salah Satu Persyaratan Memperoleh Gelar Sarjana Manajemen

**PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS NEGERI JAKARTA
2020**

**THE EFFECT OF RETURN ON EQUITY (ROE), BOOK
VALUE PER SHARE (BVPS), AND STOCK TRADING
VOLUME TO THE RETURN STOCK ON MINING SECTOR
IN INDONESIA STOCK EXCHANGE (IDX) PERIOD 2013-2018**

**JEFRI
8215161588**



**Submitted in Partial Fullfilment of The Requirements for The Degree Of
Bachelor Of Management**

**STUDY PROGRAM S1 MANAGEMENT
FACULTY OF ECONOMICS
UNIVERSITAS NEGERI JAKARTA
2020**

ABSTRAK

Jefri, 2020; Pengaruh *Return on Equity* (ROE), *Book Value Per Share* (BVPS), dan Volume Perdagangan Saham Terhadap *Return Saham Pada Sektor Pertambangan Batubara yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia* (BEI) Periode 2013-2018. Skripsi, Jakarta: Konsentrasi Keuangan, Program Studi S1 Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Negeri Jakarta.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh *Return on Equity* (ROE), *Book Value Per Share* (BVPS), dan Volume Perdagangan Saham Terhadap *Return Saham Pada Sektor Pertambangan Batubara yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia* (BEI) Periode 2013-2018. Variabel bebas yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan *Return on Equity* (ROE), *Book Value Per Share* (BVPS), dan Volume Perdagangan Saham. Variabel terikat yang digunakan adalah *Return Saham*. Data yang digunakan dalam penelitian ini berupa laporan keuangan tahunan (*annual report*) Sektor Pertambangan Batubara yang terdaftar di BEI periode 2013-2018. Metode pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan Teknik *purposive sampling*. Model yang digunakan dalam penelitian ini adalah panel dengan pendekatan *Common Effect Model*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Volume perdagangan saham berpengaruh positif signifikan terhadap *Return saham*, sedangkan *Return on Equity* (ROE) dan *Book Value Per Share* (BVPS) tidak berpengaruh terhadap *Return saham*.

Kata Kunci: *Return on Equity* (ROE), *Book Value Per Share* (BVPS), *Volume Perdagangan Saham*, *Return saham*, *Pertambangan Batubara*.

ABSTRACT

Jefri, 2020; The Effect of Return on Equity (ROE), Book Value Per Share (BVPS), and Stock Trading Volume to the Stock Return on Mining Sectors Listed by Indonesia Stock Exchange (IDX) Period 2013-2018. Thesis, Jakarta: Concentration in Finance, Study Program of Management, Faculty if Economic, Universitas Negeri Jakarta.

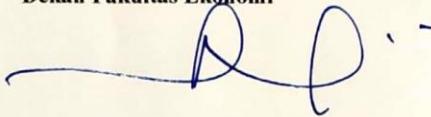
The aim of this study is to investigate the effect of Return on Equity (ROE), Book Value Per Share (BVPS), and Stock Trading Volume to the Stock Return on Mining Sectors Listed by Indonesia Stock Exchange (IDX) Period 2013-2018. Independent Variable of these study is Return on Equity (ROE), Book Value Per Share (BVPS), and Stock Trading Volume. While dependent variable is Stock Return. The data used in this study is annual report of mining sectors that published by IDX during 2013-2018. The sampling method of this study is purposive sampling technique. The research model in this study employs panel data analysis with Common Effect Model approach. The empirical result show that Stock Trading Volume have positive significantly to Stock Return, while Return on Equity (ROE) and Book Value Per Share (BVPS) no significantly influences to Stock Return.

Key Words: *Return on Equity (ROE), Book Value Per Share (BVPS), Stock Trading Volume, Mining Sectors*

LEMBAR PENGESAHAN

Penanggung Jawab

Dekan Fakultas Ekonomi



Dr. Ari Saptono, M.Pd 
NIP. 197207152001121001

Nama

Tanda Tangan

Tanggal

1. Dr. Suherman, S.E., M.Si.
NIP. 197311162006041001
(Ketua)

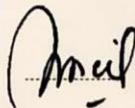


18 - 8 - 2020

2. Sholatia Dalimunthe, S.E, M.BA
NIP. 198704262015042003
(Sekretaris)

18 Agustus 2020

3. Dra. Umi Mardiyati, M.Si.
NIP. 195702211985032002
(Pengaji Ahli)



20 - 8 - 2020

4. M. Edo S. Siregar, S.E., M.BA.
NIP. 197201252002121002
(Pembimbing I)



17 Agustus 2020

5. Destria Kurnianti, S.E., M.Sc
NIP. 198712042019032011
(Pembimbing II)



17 Agustus 2020

Nama : **Jefri**
No. Registrasi : 8215161588
Program Studi : S1 Manajemen
Tanggal Lulus : 7 Agustus 2020

PERNYATAAN ORISINALITAS

Dengan ini saya menyatakan bahwa:

1. Skripsi ini merupakan karya asli dan belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik sarjana, baik di Universitas Negeri Jakarta maupun di Perguruan Tinggi lain.
2. Skripsi ini belum pernah dipublikasikan, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai bahan acuan dalam naskah dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan di dalam daftar pustaka.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya, dan apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran maka saya berani menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh, serta sanksi lainnya sesuai dengan norma yang berlaku di Universitas Negeri Jakarta.

Jakarta, 7 Agustus 2020

Yang membuat pernyataan



Jefri

No. Reg. 8215161588

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur senantiasa penulis panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa Allah SWT karena berkat Rahmat, Taufik, dan Hidayah-Nya penulis dapat menyelesaikan skripsi ini tepat waktu. Skripsi ini disusun untuk memenuhi salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana pada Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta. Judul penelitian ini adalah “Pengaruh *Return on Equity* (ROE), *Book Value Per Share* (BVPS), dan Volume Perdagangan Saham Terhadap *Return* Saham Perusahaan Sektor Pertambangan Batubara pada Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2018”.

Berbagai motivasi, bimbingan, koreksi dan bantuan diterima penulis selama penelitian ini berlangsung. Tanpa ada bantuan dari pihak lain, mungkin penulis tidak akan mampu menyelesaikan penelitian ini, oleh karena itu penulis ingin mengucapkan banyak terimakasih kepada seluruh pihak yang telah membantu dalam menyelesaikan penelitian ini khususnya kepada:

1. Dr. Ari Saptono, M.Pd. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta.
2. Dr. Suherman, S.E., M.Si. selaku Koordinator Prodi S1 Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta.
3. M. Edo S. Siregar, S.E., M.BA selaku pembimbing yang selalu memberikan semangat dan sabar dalam membimbing dan memberikan saran kepada penulis.
4. Destria Kurnianti, S.E., M.Sc. selaku pembimbing penulis yang selalu memberikan semangat dan sabar dalam membimbing dan memberikan saran kepada penulis.
5. Dr. Suherman, S.E., M.Si. selaku ketua sidang yang telah memberikan kritik dan saran kepada penulis.

6. Sholatia Dalimunthe, S.E., M.BA. selaku sekretaris siding yang telah memberikan kritik dan saran kepada penulis.
7. Dra. Umi Mardiyati, M.Si., selaku penguji ahli yang telah memberikan kritik dan saran kepada penulis.
8. Jasri dan Gusnimar selaku orang tua penulis, dan Putri Susanti selaku adik penulis yang telah memberikan dukungan, baik moral maupun material selama penulisan ini.
9. Jajaran dosen serta karyawan Universitas Negeri Jakarta khususnya Jurusan Manajemen yang telah membimbing dan membantu selama penelitian.
10. Teman-teman Jurusan Manajemen 2016 khususnya kelas D Manajemen 2016 selama perkuliahan yang selalu berjuang bersama.
11. Teman-teman mahasiswa Minangkabau yang ada di Universitas Negeri Jakarta yang selalu mengisi hari-hari penulis.
12. Tak lupa pula penulis ingin mengucapkan banyak terima kasih kepada pihak-pihak terkait lainnya yang telah banyak membantu dalam penelitian.

Penulis akui penulis tidaklah sempurna, apabila nanti terdapat kekeliruan dalam penulisan penelitian ini penulis sangat mengharapkan kritik dan sarannya. Akhir kata semoga penelitian ini dapat memberikan banyak manfaat bagi kita semua.

Jakarta, 7 Agustus 2020

Penulis