

DAFTAR PUSTAKA

- Adisetiawan,R 2009. Hubungan Tingkat Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia, Inflasi, dan Indeks Harag Saham Gabungan (IHSG). *BENEFIT Jurnal Manajemen dan Bisnis*.Vol. 13, No.1 pp: 23-33
- Akbar. Faoriko. 2013. Pengaruh Inflasi, Suku Bunga dan Nilai Tukar Rupiah, Terhadap *Return* Saham di Bursa Efek Indonesia. Universitas Negeri Yogyakarta. *Skripsi*.
- Akerlof, George A. 1970. The Market For Lemons: Quality Uncertainty and The Market Mechanisem. *Quarterly Journal of Economics*, Vol. 83, No. 4, pp. 488-500.
- Amrida.Abdullah. 2020. Pengaruh Tingkat Suku Bunga Terhadap Permintaan Kreidt Usaha Pada Koperasi Simpan Pinjam Manurung Kecamatan Wara Kota Palopo. *Jurnal Jurusan Ekonomi Pembangunan, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Palopo*.
- Andini. Nursiska Riyanti. 2018. Analisis Regresi Data Panel pada Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham di Jakarta Islamic Index (JII) 2015-2017. Universitas Islam Indonesia. *Skripsi*.
- Aprilia, Ronny. Dan Budi. 2017. Analisis Pengaruh EPS, ROE, DER, dan CR Terhadap Harga Saham dengan PER sebagai Variabel Moderating. *Jurnal Riset Manajemen fakultas ekonomi unisma*, 96-110
- Artatik, Sri. 2007. Pengaruh *Earning PerShare* dan *Price Earning Ratio* Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Jakarta, *UNNES*, Semarang. (www.google.com, diakses pada 10 Agustus 2020).
- Artaya. Made, Purbawangsa Ida Bagus Anom, Artini. Luh Gede Sri. 2014. Pengaruh Faktor Ekonomi Makro, Risiko Investasi dan Kinerja Keuangan Terhadap *Return* Saham Perusahaan di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana*. 3.12, Hal 689-701.
- Bodie, Z., Kane, A dan Marcus, A. J. 2008. *Investment*. Edisi Ketujuh. New York: Mc-Graw-Hill
- Dita Amelia.Linda.2016.Pengaruh Internet Financial Reporting,Ketepatan Waktu Penyampaian Informasi Keuangan Website, Ukuran Perusahaan, dan Profitabilitas Terhadap Abnormal Return. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Ekonomi Akuntansi*. Vol. 1, No.2.210-226.
- Dhiarswara.Alang, dan Gusyana. Tieka. 2019. Pengaruh Inflasi, Suku Bunga dan Nilai Tukar Terhadap Harga Saham Perusahaan Subsektor Batubara Periode 2013-2017. *E-Proceeding Of Management*:Vol.6 No.3 pp: 5592
- Fahmi, I. 2012. *Pengantar Pasar Modal*. Edisi Kedua. Bandung: Alfabeta.

- Fama, F. Eugene. 1970. Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Work. *The Journal of Finance*. 383-417.
- Ghozali, Imam. 2018. *Aplikasi Analisis Multivariete Dengan Program IBM SPSS 25*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hadianto. B. Ronny. 2007. Pengaruh Volume Perdagangan, EPS dan PER Terhadap Sektor Pertambangan pada Periode 2000-2005. *Jurnal manajemen Maranatha*. Vol 7. No.1. 55-72
- Hermawan, Dedi Aji. Pengaruh Debt to Equity Ratio, Earning Per Share dan Profit Margin Terhadap Return Saham. *Management Analysis Journal*, 1(5), h:1-7
- Hilal, F. 2009. Pengaruh Laba Akuntansi, Total Arus Kas dan Net Profit Margin Terhadap Return Saham Perusahaan Asuransi yang Terdaftar pada Bursa Efek Indonesia. (<http://www.uji.ac.id>, diakses 10 Agustus 2020).
- Husnan, Suad dan Enny Pudjiastuti. 2006. *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*. Edisi Kelima. UPP STIM YKPN: Yogyakarta.
- Iis Surgawati, Andri Helmi Munawar, dan Dede Arif Rahmani. 2019. Firm Size Memoderasi Pengaruh Return On Equity terhadap Harga Saham. *Jurnal Ekonomi Manajemen*. 5(1),41-50.
- Jumiati. Halima. 2019. Analisis Pengaruh Faktor Fundamental, Perusahaan dan kondisi Makro Ekonomi Terhadap Abnormal Return. *Elektronik jurnal riset akuntansi vol. 08 No. 10 fakultas ekonomi dan bisnis Universitas Islam Malang*
- Jogiyanto, H.M 2008, *Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. UPP AMP YKPN. Yogyakarta.
- Jogiyanto, H.M 2010. *Analisis dan Desain Sistem Informasi*. Edisi Keempat. Yogyakarta: Andi Offset.
- Kasmir. 2012. *Analisis Laporan Keuangan*. Jakarta: Rajawali Pers
- Krismiaji dan Anni Aryani. Y. 2019. *Akuntansi Manajemen*. Edisi Ketiga. UPP STIM YKPN: Yogyakarta Juharni. 2017.
- Lilis.Purnamasari. 2017. Pengaruh Return on Asset dan Return on Equity Terhadap Return Saham (Studi Kasus pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2010-2015). *Jurnal Univesitas PGRI Yogyakarta*.
- Martalena dan Maya Malinda. 2011. *Pengantar Pasar Modal*. Andi Offset. Yogyakarta.
- Michael.B. Mahilo, dan Tommy.Parengkuan. 2015. Dampak Risiko Suku Bunga, Infalsi, dan Kurs Terhadap Return Saham Perusahaan Makanan dan Minuman yang Go Public di Bursa Efek Indonesia. *Journal EMBA*, Vol. 3, No.3 pp:1-10.

- Monang.Juanda dan Suhendri.Nasution. 2018. Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi *Return* Saham dengan Harga Saham Sebagai Variabel Moderating Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Journal Of Informastion Technology and Accounting*, Vol. I, No.1
- Muksal. 2016. Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham Syariah (Studi pada Pasar Sekunder *Jakarta Islamic Index* Tahun 2009-2013. *Jurnal Fakultas Syariah dan Dakwah Universitas Serambi Mekkah*. (Survey pada Sektor Food and Beverage yang Listing di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi Manajemen*. 5 (1), 41-50.
- Natarsyah.Syahib.2000. Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental dan Resiko Sistematis Terhadap Harga Saham: Kasus Industri Barang Konsumsi yang Go Public di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*. Vol.15 No.3.pp:294-312
- Novianto.2011:22. *Tingkat Suku Bunga dan Jenis-Jenis Suku Bunga*.Bandung
- Nur.Chozaemah. 2004. Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental Terhadap Perubahan Harga Saham (Studi Pada Perusahaan Barang dan Konsumsi yang Go Public di BEJ). *Tesis*.
- Nurhayat dan Sofyan, M Edy. 2017. *Saham Tambang Jadi Primadona Tahun Lalu, Bagaimana Dengan Tahun Ini? (Online)*, (<https://m.kumparan.com/wiji-nurhaya/saham-tambang-jadi-primadina-tahun-lalu-bagaimana-dengan-tahun-ini/>, diakses 21 April 2020).
- Purnomo. Tri Hendra dan Widyatati. Nurul. 2013. Pengaruh Nilai Tukar, Suku Bunga, dan Inflasi Terhadap Return Saham pada Perusahaan Properti. *Jurnal Ilmu dan Riset Manajemen*. Vol. 2. No.3.pp:1-20
- Putranto. Ashari Dwi dan Darmawan. Ari. 2018. Pengaruh Ukuran Perusahaan, Profitabilitas, Leverage, dan Nilai Pasar terhadap Harga Saham (Studi Kasus pada Perusahaan Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia 2010-2016. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, Vol. 56. No.1
- Rabiatur. Adahwiyah. 2015. Reaksi Signal Rasio Profitabilitas dan Rasio Solvabilitas Terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2014. *Jurnal Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Bandung*. 170-184.
- Raden Tinneke. 2007. *Analisis Pengaruh Economic Value Added (EVA) dan Faktor-faktor Fundamental Perusahaan Lainnya Terhadap Return Saham (Studi Empiris Pada Perusahaan Sektor Industri Manufaktur di Bursa Efek Jakarta)*. Tesis. Semarang: Program Studi Magister Manajemen Universitas Diponegoro.
- Rafique, Mahira. 2012. Factors Affecting Dividend Payout: Evidence From Listed Non-Financial Firms of Karachi Stock Exchange. *Business Management Dynamics*, 1(11), pp: 67-93

- Reilly, K. Frank Brown, dan C. Keith. 2011. *Investment Analysis and Portofolio Management*. 10th Edition. South-Western College Pub.
- Riantani, S. dan Tambunan, M. 2013. Analisis Pengaruh Variabel Makroekonomi dan Indeks Global Terhadap Return Saham. *Semantik*. pp:532-537.
- Permana, Sidiq Jatimana. 2017. Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi abnormal Return Saham pada Perusahaan Perbankan dan Asuransi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Bisnis dan Manajemen*, Vol. 11, No. 1. 12-27
- Sakti, Tutus Alun Asoka. 2010. Pengaruh *Return On Assest* dan *Debt To Equity Ratio* Terhadap *Return* Saham Perusahaan yang Terdaftar si Bursa Efek Indonesia (Kasus Pada Sektor Manufaktur Periode Tahun 2005-2007). *Jurnal Ilmu Manajemen dan Akuntansi Terapan*, 1(1), h:1-12
- Sari.Murni. 2020. Pengaruh Nilai Pasar dan Faktor Fundamental Terhadap *Abnormal Return* (Studi pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2012-2016. *Jurnal Economix* Vol.8 No.1.
- Satria. Made. Dan Komang Luh. 2016. Pengaruh Tingakt Suku Bunga, Tingkat Inflasi, Nilai Kurs Rupiah dan Produk Domestik Bruto Terhadap *Return* Saham. *E-Jurnal Manajemen Unud*. Vol.5 No.6 , pp:3392-3420
- Sekaran, U. dan Bougie, R. 2016. *Research Method for Bussnies*. 7th Edition. Chichester: John Willey & Sons Ltd.
- Sugiyono. 2017. *Statistika untuk Penelitian*. Cetakan Kesepuluh. Bandung: Alfabeta.
- Sunariyah. 2011. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Keenam. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Syamsuddin, Lukman. 2004. *Manajemen Keuangan Perusahaan*. Jakarta: Raja Grafindo Persada.
- Virginia, Sheila, Elisabeth, M. T. Dan Muliawati. 2012. Pengaruh Pengumuman Earnings Terhadap Abnormal Return Saham. *Jurnal Administrasi Bisnis*.4-24.
- Wiguna,R dan Mendari, A. S. 2008. Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) dan Tingkat Bunga SBI terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di LQ45 Bursa Efek Indonesia, *Jurnal Keuangan dan Bisnis*. 6(2), 130-142
- Wiratna. V. 2017. *Metodologi Penelitian Bisnis dan Ekonomi Pendekatan Kuantitaif*. PUSTAKABARUPRESS.
- www.fiansialku.com (Diakses pada tanggal 20 November 2019)
- www.idx.or.id (Diakses Pada tanggal 14 Januari 2020)
- www.sahamok.com (Diakses pada tanggal 14 Januari 2020)

LAMPIRAN

Lampiran 1. Biodata**BIODATA****Identitas Diri**

Nama : Muh. Akram Sidik
 Tempat, Tanggal Lahir : Kajang, 07-Maret-1998
 Jenis Kelamin : Laki-laki
 Alamat Rumah : Jln. DR. Leimena
 Komp IDI Bukit Batu Lr 15
 Telpon Rumah dan HP : 085255290248
 Alamat E-mail : muh.akramsidik98@gmail.com

**Riwayat Pendidikan**

- a. Pendidikan Formal
 - 2004-2010: SD Muhammadiyah Tello Baru
 - 2010-2013: SMP Negeri 19 Makassar
 - 2013-2016: SMA Negeri 12 Makassar
 - 2016-Sekarang: S1 Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Hasanuddin Makassar
- b. Pendidikan Nonformal
 - LK 1 Senat Mahasiswa FEB Universitas Hasanuddin
 - Pelatihan Bisnis Model Canvas Islamic Socioprenuer Development Program Bank Syariah Mandiri
 - Pelatihan Student Volunteer Universitas Hasanuddin

Riwayat Organisasi

- Pengurus Ikatan Mahasiswa Akuntansi FEB-UH
- Pengurus Keluarga Mahasiswa Masjid Darul Ilmi FEB-UH
- Pengurus Futsal Fakultas Ekonomi dan Bisnis (Ekowowits)
- Pendiri Akuntan Muda Makassar
- Student Volunteer Universitas Hasanuddin

Demikian biodata ini dibuat dengan sebenarnya.

Makassar, 13 Maret 20202

Muh. Akram Sidik

Lampiran 2. Hasil Pengumpulan Sampel

No.	Nama Perusahaan
1.	Adro Energy Tbk.
2.	Bumi Resources Minerals Tbk.
3.	Atlas Resources Tbk.
4.	Bumi Resources Tbk.
5.	Bayan Resources Tbk.
6.	Delta Dunia Makmur Tbk.
7.	Indo Tambangraya Megah Tbk.
8.	Resources Alam Indonesia Tbk.
9.	Mitrabara Adiperdana Tbk.
10.	Samindo Resources Tbk.
11.	Perdana Karya Perkasa Tbk.
12.	Bukit Asam Tbk.
13.	Petroesa Tbk.
14.	Golden Eagle Energy Tbk.
15.	Toba Bara Sejahtera Tbk.
16.	Darma Henwa Tbk.
17.	Harum Energy Tbk.

Sumber : www.idx.co.id, www.sahamok.com

Lampiran 3 . Data penelitian (DER, ROE, EPS Suku Bunga dan *Abnormal Return*)

NO	TAHUN	CO	X				Y
			DER (X1)	ROE(X)	EPS(X)	SUKU BUNGA (X4)	ABR(Y)
1	2016	BRMS	0.07	-87.910	-11.001	6.000	0.012
2	2017	BRMS	0.34	-30.872	0.000	4.560	0.018
3	2018	BRMS	0.32	-14.324	-14.000	5.100	-0.014
4	2016	ARII	0.42	-0.453	4.025	6.000	0.038
5	2017	ARII	0.12	-0.420	1.134	4.560	0.033
6	2018	ARII	0.27	-13.000	11.089	5.100	-0.018
7	2016	BUMI	0.52	-12.318	-10.002	6.000	-0.019
8	2017	BUMI	0.66	25.628	9.006	4.560	0.071
9	2018	BUMI	0.48	14.003	-13.003	5.100	-0.052
10	2016	BYAN	0.34	0.096	-9.001	6.000	-0.017
11	2017	BYAN	0.07	-14.656	-9.096	4.560	-0.067
12	2018	BYAN	0.07	-24.773	-8.150	5.100	0.005
13	2016	DOID	0.60	29.327	-10.004	6.000	0.004
14	2017	DOID	0.43	0.264	-12.006	4.560	0.020
15	2018	DOID	0.35	0.289	-9.479	5.100	0.002
16	2016	HRUM	0.02	-50.586	-9.005	6.000	0.084
17	2017	HRUM	0.25	-11.141	-9.017	4.560	0.011
18	2018	HRUM	0.23	10.349	-8.012	5.100	0.011
19	2016	ITMG	0.64	-14.400	-10.128	6.000	0.010
20	2017	ITMG	0.43	-24.400	10.239	4.560	-0.002
21	2018	ITMG	0.31	-26.700	-18.250	5.100	-0.076
22	2016	KKGI	0.31	-11.220	-10.018	6.000	-0.002
23	2017	KKGI	0.42	-25.170	-19.321	4.560	0.035
24	2018	KKGI	0.33	0.550	-14.000	5.100	0.065
25	2016	MBAP	0.31	0.296	-6.022	6.000	0.095
26	2017	MBAP	0.13	-9.479	0.548	4.560	0.018
27	2018	MBAP	0.24	-23.405	0.751	5.100	0.002
28	2016	MYOH	0.35	-23.198	-11.479	6.000	-0.011

29	2017	MYOH	0.42	0.120	-10.006	4.560	-0.078
30	2018	MYOH	0.53	27.133	-10.014	5.100	0.007
31	2016	PKPK	0.43	-19.590	-25.974	6.000	-0.053
32	2017	PKPK	0.13	-17.600	-19.979	4.560	-0.114
33	2018	PKPK	0.13	-21.040	-7.763	5.100	0.013
34	2016	PTBA	0.18	-19.532	0.064	6.000	0.040
35	2017	PTBA	0.24	-20.353	-11.029	4.560	0.008
36	2018	PTBA	0.52	-25.235	0.032	5.100	0.003
37	2016	PTRO	0.43	-0.046	-0.008	6.000	0.077
38	2017	PTRO	0.24	-20.011	-9.008	4.560	-0.017
39	2018	PTRO	0.29	-21.121	-10.023	5.100	0.044
40	2016	SMMT	0.48	-0.057	5.218	6.000	0.012
41	2017	SMMT	0.37	21.096	-9.860	4.560	0.008
42	2018	SMMT	0.27	-16.173	2.432	5.100	0.016
43	2016	TOBA	0.26	21.099	1.001	6.000	0.021
44	2017	TOBA	0.49	-12.237	-10.065	4.560	-0.026
45	2018	TOBA	0.63	-23.316	-12.019	5.100	-0.061
46	2016	ADRO	0.33	-25.090	-13.010	6.000	-0.005
47	2017	ADRO	0.07	-23.131	-9.015	4.560	-0.083
48	2018	ADRO	0.66	-14.111	-10.013	5.100	0.071
49	2016	DEWA	0.07	-25.002	-9.324	6.000	0.013
50	2017	DEWA	0.31	-10.274	0.139	4.560	-0.087
51	2018	DEWA	0.06	-19.012	-11.022	5.100	0.075

Lampiran 4 . Hasil uji Statistik Deskriptif**Descriptive Statistics**

	N	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation
ABNORMAL	51	-.11	.09	.0027	.04625
DER	51	-9.51	.66	.3249	.17175
ROE	51	-87.91	29.33	-11.7863	19.67680
EPS	51	-25.97	11.09	-7.1267	7.69596
SUKU BUNGA	51	4.56	6.00	5.2200	.59988
Valid N (listwise)	51				

Lampiran 5 . Hasil uji Asumsi Klasik

1. Uji Normalitas

		Unstandardized Residual
N		51
Normal Parameters ^{a,b}	Mean	.0000000
	Std. Deviation	.04186553
	Absolute	.083
Most Extreme Differences	Positive	.083
	Negative	-.070
Kolmogorov-Smirnov Z		.591
Asymp. Sig. (2-tailed)		.876

a. Test distribution is Normal.

b. Calculated from data.

2. Uji Heteroskedastisitas

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
		B	Std. Error	Beta		
1	(Constant)	.081	.033		2.479	.017
	DER (X1)	-9.51	.000	-.004	-.028	.978
	ROE (X2)	2.95	.000	.022	.138	.891
	EPS (X3)	-.001	.000	-.213	-1.495	.142
	SUKU BUNGA (X4)	-.010	.006	-.232	-1.635	.109

a. Dependent Variable: Abs_RES

3. Uji Multikolonieritas

Coefficients^a

Model	Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.	Collinearity Statistics		
	B	Std. Error	Beta			Tolerance	VIF	
	1	(Constant)	-.101			.055		
	DER (X1)	-9.51	.000	-.035	-.235	.815	.785	1.274
	ROE (X2)	.000	.000	.061	.401	.690	.764	1.309
	EPS (X3)	.002	.001	.307	2.262	.028	.968	1.033
	SUKU BUNGA (X4)	.023	.010	.301	2.230	.031	.975	1.025

a. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)

4. Uji Autokorelasi

Model Summary^b

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.534 ^a	.285	.207	.0403547888	2.086

a. Predictors: (Constant), SUKU BUNGA (X4), EPS (X3), DER (X1), ROE (X2)

b. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)

Lampiran 6 . Hasil Uji Hipotesis

1. Uji Regresi Linear Berganda

Coefficients^a

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized	t	Sig.
		B	Std. Error	Coefficients Beta		
1	(Constant)	-.101	.055		-1.839	.072
	DER (X1)	-9.51	.000	-.035	-.235	.815
	ROE (X2)	.000	.000	.061	.401	.690
	EPS (X3)	.002	.001	.307	2.262	.028
	SUKU BUNGA (X4)	.023	.010	.301	2.230	.031

a. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)

2. Uji Statistik F

ANOVA^a

Model		Sum of Squares	Df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	.019	4	.005	2.632	.043 ^b
	Residual	.088	46	.002		
	Total	.107	50			

a. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)

b. Predictors: (Constant), SUKU BUNGA (X4), EPS (X3), DER (X1), ROE (X2)

3. Uji Statistik t

Coefficients^a

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized	t	Sig.
		B	Std. Error	Coefficients Beta		
1	(Constant)	-.101	.055		-1.839	.072
	DER (X1)	-9.51	.000	-.035	-.235	.815
	ROE (X2)	.000	.000	.061	.401	.690
	EPS (X3)	.002	.001	.307	2.262	.028
	SUKU BUNGA (X4)	.023	.010	.301	2.230	.031

a. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)

4. Uji Koefisien Determinasi (R²)

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.534 ^a	.285	.207	.0403547888	2.086

a. Predictors: (Constant), SUKU BUNGA (X4), EPS (X3), DER (X1), ROE (X2)

b. Dependent Variable: ABNORMAL RETURN (Y)