

BAB III

METODE PENELITIAN

3.1 Jenis dan Pendekatan Penelitian

Menurut Prof. Dr. Sugiyono (2020-2024) Metode penelitian adalah cara ilmiah dalam mendapatkan data yang valid dengan tujuan dan kegunaan tertentu. Menekankan keilmiahannya yang melalui tindakan rasional, empiris, sistematis bertujuan memperoleh data dan pengetahuan baru, membantu mengembangkan teori dan pengambilan keputusan.

Menurut Prof. Dr. John W Creswell (2023-2024) Metode penelitian adalah langkah-langkah yang sistematis, logis, dan objektif yang diambil oleh peneliti untuk memperoleh jawaban atas pertanyaan penelitian, merumuskan metodenya sebagai struktur yang mencakup perencanaan, pengumpulan data, analisis, dan interpretasi, semua dilaksanakan sistematis dan objektif.

Menurut Robert K. Yin (2024) Metode Penelitian adalah strategi atau rencana umum yang digunakan oleh peneliti untuk mengumpulkan dan menganalisis data guna menjawab pertanyaan penelitian, menyoroti pentingnya rencana penelitian (design), mencakup aspek seperti pemilihan sampel dan teknis analisis

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan metode deskriptif asosiatif. Metode deskriptif bertujuan menggambarkan secara sistematis keadaan suatu variabel (atau beberapa variabel) tanpa mencari hubungan atau pengaruh antar variabel. Menurut Sugiyono (2018) Metode deskriptif adalah metode penelitian yang dilakukan untuk menggambarkan variabel mandiri, baik hanya pada satu variabel atau lebih (variabel yang berdiri sendiri) tanpa membuat perbandingan dan mencari variabel itu dengan variabel lain

Metode penelitian asosiatif bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat hubungan antara dua variabel atau lebih, dan kadang mencari arah serta kekuatan pengaruhnya. Menurut (hlm. 65) 2019 Penelitian asosiatif merupakan suatu rumusan masalah penelitian yang bersifat menanyakan hubungan antara dua variabel atau lebih

Pendekatan dipilih karena penelitian bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Return on Asset* (ROA) sebagai variabel independen terhadap harga saham sebagai variabel dependen. Analisis yang dilakukan berdasarkan data numerik yang bersumber dari laporan keuangan dan harga saham PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk periode 2020-2024. Data yang digunakan berupa angka (kuantitatif).

3.2 Lokasi dan Waktu Penelitian

Penelitian ini dilaksanakan di PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk Adapun waktu pelaksanaan penelitian dimulai dari bulan Februari hingga bulan Juli tahun 2024 dengan jadwal tugas akhir yang telah ditetapkan.

3.3 Populasi dan Sampel Penelitian

Menurut Definition by Muchlisin Riadi (2022) Populasi adalah keseluruhan, totalitas atau generalisasi dari satuan, individu, objek yang mempunyai kuantitas dan karakteristik tertentu yang akan diteliti. Selain manusia, populasi juga bisa berupa benda, institusi, peristiwa. Unit analisis bisa berupa individu, kelompok, atau organisasi tergantung tujuan penelitian. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh laporan keuangan dan data harga saham PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk dari tahun 2020 hingga 2024. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah data tahunan Return on Asset (ROA) dan harga saham

penutupan tahunan PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk selama periode 2020 sampai 2024, sehingga total sampel sebanyak data observasi Populasi Penelitian

Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh data laporan keuangan dan harga saham PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk yang dipublikasikan selama periode tahun 2020 hingga 2024. Data tersebut meliputi informasi keuangan yang tercatat di Bursa Efek Indonesia (BEI) dan laporan tahunan resmi PT BNI.

Sampel penelitian diambil dengan menggunakan metode purposive sampling, yaitu dengan memilih data laporan keuangan dan harga saham PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk yang lengkap dan tersedia secara konsisten selama periode 2020-2024. Sampel ini berupa data tahunan yang digunakan untuk menganalisis pengaruh ROA terhadap harga saham.

3.4 Jenis dan Sumber Data

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder berupa laporan keuangan tahunan dan harga saham tahun 2020-2024, yaitu data yang diperoleh secara tidak langsung melalui dokumentasi atau publikasi dari pihak terkait.

Data sekunder adalah data yang sudah tersedia sebelumnya, dikumpulkan oleh pihak lain dan digunakan oleh peneliti secara langsung. Data ini berasal dari dokumen, laporan, statistik, artikel, ataupun hasil penelitian sebelumnya. Menurut S. C Gupta dan Kothari (Via tekno spesial, 2024) “data yang sudah tersedia dan dikumpulkan oleh entitas lain untuk tujuan lain, tetapi digunakan kembali oleh peneliti untuk kepentingan penelitian mereka”

Sumber data dalam penelitian ini meliputi:

- Laporan keuangan tahunan PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk yang diperoleh dari situs resmi perusahaan dan Bursa Efek Indonesia (www.idx.com)
- Data harga saham tahunan yang diperoleh dari sumber resmi Bursa Efek Indonesia.

3.5 Definisi Operasionalisasi Variabel

Operasionalisasi variabel jembatan antara teori dan realitas lapangan, karena membantu memastikan bahwa apa yang hendak diuji benar-benar dapat diamati dan dicatat dalam bentuk data (Sugiyono, 2024)

Penelitian ini memiliki dua variabel utama:

1. Variabel independen (X): Return on Asset (ROA)

ROA adalah rasio probabilitas yang mengukur kemampuan perusahaan dalam menghasilkan laba bersih dari total aset yang dimilikinya. Rumus perhitungan ROA:

$$ROA = \frac{\text{Laba Bersih}}{\text{Total Aset}} \times 100\%$$

2. Variabel dependen (Y): Harga Saham

Harga saham yang dimaksud adalah harga saham penutupan tahunan (closing price) yang mencerminkan nilai pasar saham perusahaan pada akhir tahun.

Tabel 3. 1 Operasionalisasi Variabel

Variabel	Definisi Operasional	Indikator	Satuan/skala
Return On Aset (ROA)	ROA adalah rasio yang mengukur kemampuan perusahaan dalam menghasilkan laba bersih dari seluruh aset yang dimiliki. ROA menunjukkan efisiensi penggunaan asset dalam menghasilkan keuntungan. (Kasmir, 2019; Ang, 1997).	<ul style="list-style-type: none"> • Laba bersih (net profit) • Total asset • Persentase ROA (%) 	Persentase (%)
Harga Saham	Harga saham adalah nilai pasar per lembar saham PT Bank Negara Indonesia (Persero) yang tercatat di Bursa Efek Indonesia selama periode 2020-2024. Harga saham mencerminkan nilai dan persepsi investor terhadap perusahaan.	<ul style="list-style-type: none"> • Harga pasar saham (market place) • Volume perdagangan harga saham • Volatilitas harga saham • Return saham (capital gain & deviden) 	Rp

3.6 Teknik Pengumpulan Data

Teknik pengumpulan data dilakukan dengan dokumentasi, yaitu dengan cara mengumpulkan laporan keuangan dan data harga saham perusahaan dari sumber resmi seperti website Bursa Efek (BEI) dan laporan tahunan perusahaan.

3.7 Teknik Analisis Data

Teknik analisis data adalah prosedur atau metode yang digunakan untuk mengolah data mentah menjadi informasi yang mudah dipahami, berguna dan tepat untuk menjawab permasalahan penelitian.

Dalam penelitian ini, data analisis menggunakan teknik statistik sebagai berikut:

1. Statistik Deskriptif

Digunakan untuk menggambarkan karakteristik data masing-masing variabel berupa nilai minimum, maksimum, rata-rata, dan standar deviasi, agar peneliti dan pembaca bisa memahami karakteristik umum dan data sebelum dilakukan analisis lebih lanjut (Sugiyono, 2017; Ghozali, 2018).

2. Uji Asumsi Klasik

Dilakukan untuk menguji kelayakan model regresi yang digunakan. Salah satu asumsi dasar regresi linier adalah data harus berkontribusi normal jika tidak, maka hasil regresi bisa bias. *Ghozali, I. (2018). Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.*

Uji asumsi klasik meliputi:

a) Uji Normalitas

Uji normalitas bertujuan untuk mengetahui apakah data residual (selisih antara nilai aktual dan prediksi) dalam model regresi terdistribusi secara normal. Distribusi normal penting karena salah satu asumsi dasar dalam analisis regresi adalah bahwa error (kesalahan) harus berdistribusi normal.

Metode yang umum digunakan:

- Uji Kolmogorov-Smirnov (K-S)
- Uji Shapiro-Wilk (terutama jika jumlah data < 50)
- Melihat grafik histogram atau normal probability plot (P-P Plot)

Kriteria pengambilan keputusan:

- Jika nilai signifikansi (Sig.) $> 0,05$, maka data berdistribusi normal
- Jika nilai signifikansi (Sig.) $< 0,05$, maka data tidak berdistribusi normal

b) Uji Heteroskedastisitas

Uji ini digunakan untuk melihat apakah terjadi ketidaksamaan varians (variasi error) pada setiap nilai variabel independen. Model regresi yang baik adalah yang memiliki homoskedastisitas, yaitu error memiliki varians yang konstan.

Metode yang umum digunakan:

- Uji Glejser (regresi nilai absolut residual terhadap variabel independen)
- Uji Park atau White Test
- Melihat pola pada scatterplot antara residual dan prediksi

Kriteria pengambilan keputusan (Glejser Test):

- Jika nilai signifikansi $> 0,05$, maka tidak terjadi heteroskedastisitas
- Jika nilai signifikansi $< 0,05$, maka terjadi heteroskedastisitas

c) Uji Autokorelasi

Autokorelasi adalah kondisi di mana error pada satu observasi berkorelasi dengan error pada observasi lainnya, umumnya ditemukan pada data runtun waktu (time series).

Metode yang umum digunakan:

- Durbin-Watson Test

Kriteria pengambilan keputusan:

- Nilai Durbin-Watson (DW) mendekati 2 \rightarrow tidak ada autokorelasi
- Nilai DW $< 1,5 \rightarrow$ kemungkinan terjadi autokorelasi positif
- Nilai DW $> 2,5 \rightarrow$ kemungkinan terjadi autokorelasi negatif

3. Uji Hipotesis atau analisis regresi linier sederhana

a. Metode Analisis :

Analisis regresi linier sederhana untuk menguji pengaruh ROA terhadap harga saham.

b. Statistik Uji

- Uji t (parsial) untuk menguji signifikansi pengaruh ROA terhadap harga saham.
- Koefisien determinasi (R^2) untuk mengetahui seberapa besar variasi harga saham yang dijelaskan di ROA

c. Kreteria Pengambilan Keputusan

- Jika nilai signifikansi (p-Value) $< 0,05$, maka H_0 ditolak dan H_1 diterima, artinya ROA berpengaruh signifikan terhadap harga saham
- Jika nilai signifikansi (p-Value) $> 0,05$ maka H_0 diterima dan H_1 di tolak, artinya ROA tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham