

DAFTAR ISI

	Halaman
INSTASI	i
ABSTRAK	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	5
1.3 Tujuan Masalah.....	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Kerangka Pemikiran	6
1.6 Hipotesis	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Pasar Modal	14
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	14
2.1.2 Jenis – Jenis Pasar Modal	15
2.1.3 Manfaat Pasar Modal	16
2.1.4 Peranan Pasar Modal	17
2.1.5 Efisiensi Pasar Modal	18
2.1.6 Investasi	19
2.1.6.1 Pengertian Investasi.....	19
2.1.6.2 Jenis Investasi.....	20

2.1.6.3	Keuntungan Investasi Pada Saham.....	21
2.1.7	Saham.....	22
2.1.7.1	Pengertian Saham Biasa.....	23
2.1.7.2	Hak Saham Biasa.....	23
2.1.8	Market Value Saham.....	23
2.2	Risk Of Return.....	25
2.2.1	Resiko Dalam Investasi.....	26
2.3	Return On Asset (ROA).....	28
2.3.1	Pengertian Return Saham.....	29
2.4	Closing Price.....	30
2.5	Pengaruh Market Value Dan Risk Of Return Terhadap ROA.....	30

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Populasi Dan Sampel.....	34
3.2	Jenis Dan Sumber Data.....	35
3.3	Operasional Variabel.....	36
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	37
3.5	Metode Analisis.....	37
3.5.1	Statistik Deskriptif.....	37
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	37
3.5.2.1	Uji Normalitas.....	37
3.5.2.2	Uji Heteroskedastisitas.....	38
3.5.2.3	Uji Autokorelasi.....	38
3.5.2.4	Uji Multikolinearitas.....	39
3.5.3	Uji Hipotesis.....	40
3.5.3.1	Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	40
3.5.3.2	Uji F (Simultan).....	40
3.5.3.3	Uji T (Parsial).....	41

3.5.4 Variabel Moderating	42
---------------------------------	----

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Perkembangan Market Value Dan Risk Of Return Periode Tahun 2010-2013 Yang Termasuk Ke JII (Jakarta Islamic Index).....	43
4.1.1 Market Value	43
4.1.2 Risk Of Return	48
4.2 Perkembangan ROA Yang Terjadi Pada Perusahaan JII Pada Tahun 2010-2013	52
4.3 Perkembangan Closing Price Yang Terjadi Pada Perusahaan JII Pada Tahun 2010-2013	57
4.4 Perkembangan Market Value Dan Risk Of Return Terhadap ROA Secara Parsial Dan Similtan Pada Perusahaan Yang Termasuk Dalam Perusahaan JII	58
4.4.1 Uji Asumsi Klasik.....	58
4.4.1.1 Uji Normalitas	58
4.4.1.2 Uji Heteroskedasitas.....	60
4.4.1.3 Uji Asumsi Autokorelasi	61
4.4.1.4 Uji Multikolinieritas	62
4.4.2 Uji Hipotesis	63
4.4.2.1 Uji T	63
4.4.2.2 Uji F.....	65
4.4.2.3 Koefisiensi Determinasi	66
4.4.2.4 Variabel Moderating.....	67

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	69
5.2 Saran	71

DAFTAR PUSTAKA	73
LAMPIRAN.....	75



DAFTAR TABEL

	Halaman
3.1 Daftar Saham Yang Yang Selama 4 Tahun Berturut-Turut Tercatat Sebagai Saham Yang Teraktif Di JII.....	35
3.2 Operasionalisasi Variabel	36
4.1 Nilai Market Value (%) 20 Perusahaan Yang Tercatat Di JII.....	43
4.2 Nilai Risk Of Return (%) 20 Perusahaan Yang Tercatat Di JII.....	48
4.3 Nilai ROA 20 Perusahaan Yang Tercatat Di JII.....	53
4.4 Nilai Closing Price 20 Perusahaan Yang Tercatat Di JII.....	57
4.5 Hasil Pengujian Uji Normalitas.....	59
4.6 Hasil Pengujian Uji Asumsi Autokolerasi.....	61
4.7 Hasil Pengujian Uji Asumsi Multikolinieritas.....	62
4.8 Hasil Uji T	63
4.9 Hasil Uji F	65
4.10 Hasil Uji Koefisiensi Determinasi.....	66
4.11 Hasil Uji Moderating.....	67
4.12 Hasil Uji Variabel Moderating Berganda.....	67

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
1.1 Skema Kerangka Pemikiran	12
4.1 Grafik Normalitas	59
4.2 Grafik Uji Heteroskedasitas	60



LAMPIRAN

Lampiran 1: Ouput Spss

Lampiran 2: Output Moderating

Lampiran 3: Tabel Durbin

Lampiran 4: Tabel T

Lampiran 5: Tabel F

Lampiran 6: Grafik Market Value

Lampiran 7: Grafik Risk Of Return

Lampiran 8: Grafik ROA

