

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	13
1.4 Sistematika Penulisan	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	17
2.1 Landasan Teori.....	17
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	17
2.1.2 Jenis dan Fungsi Pasar Modal.....	17
2.1.3 Instrumen Investasi yang Diperdagangkan di Pasar Modal..	18
2.1.4 Perbankan.....	19
2.1.5 <i>Expected Return</i>	20

2.1.5.1 <i>Capital Asset Pricing Model</i>	20
2.1.5.2 <i>Single Index Model</i>	23
2.1.6 <i>Trading Volume Activity</i>	24
2.1.7 Analisa Laporan Keuangan.....	25
2.1.7.1 <i>Total Asset Turnover</i>	26
2.1.7.2 <i>Book to Market Ratio</i>	26
2.1.7.3 <i>Debt Equity Ratio</i>	27
2.2 Penelitian Terdahulu	28
2.3 Hubungan Antar Variabel dan Rumusan Hipotesis	34
2.3.1 Pengaruh TATO terhadap TVA.....	35
2.3.2 Pengaruh BMR terhadap TVA.....	35
2.3.3 Pengaruh DER terhadap TVA.....	36
2.3.4 Pengaruh TATO terhadap E(Ri)	37
2.3.5 Pengaruh BMR terhadap E(Ri).....	37
2.3.6 Pengaruh DER terhadap E(Ri).....	38
2.3.7 Pengaruh TVA terhadap E(Ri).....	39
2.3.8 TVA Memediasi Hubungan Antara TATO dan E(Ri).....	40
2.3.9 TVA Memediasi Hubungan Antara BMR dan E(Ri).....	40
2.3.10 TVA Memediasi Hubungan Antara DER dan E(Ri)	41
2.4 Kerangka Pemikiran.....	42
2.5 Hipotesis	42
BAB III METODE PENELITIAN	44
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	44
3.1.1 Variabel Penelitian.....	44
3.1.2 Definisi Operasional	45

3.1.2.1 Variabel Independen	45
3.1.2.2 Variabel Intervening	46
3.1.2.3 Variabel Dependen.....	47
3.2 Populasi dan Sampel	49
3.2.1 Populasi.....	49
3.2.2 Sampel.....	49
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	51
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	51
3.5 Metode Analisis	51
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	52
3.5.2 Uji Hipotesis	52
3.5.2.1 Uji Asumsi Klasik.....	52
3.5.2.2 Uji Model	56
3.5.2.2.1 Koefisien Determinasi (R^2).....	56
3.5.2.2.2 Uji Statistik F	56
3.5.2.2.3 Uji Statistik t	57
3.5.2.2.4 Analisis Jalur (<i>Path Analysis</i>).....	57
3.5.2.2.5 Sobel Test.....	60
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	62
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	62
4.1.1 Deskripsi Umum Objek Penelitian	62
4.1.2 Statistik Deskriptif	63
4.2 Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	65
4.2.1 Pengujian Asumsi Klasik.....	66
4.2.1.1 Uji Normalitas.....	66

4.2.1.2 Uji Multikolinieritas.....	69
4.2.1.3 Uji Autokorelasi.....	70
4.2.1.4 Uji Heterokedastisitas	70
4.2.2 Uji Model	72
4.2.2.1 Koefisien Determinasi (R^2).....	72
4.2.2.2 Uji Statistik F	74
4.2.2.3 Uji Statistik t	75
4.2.2.4 Analisis Jalur (<i>Path Analysis</i>).....	81
4.2.2.5 Sobel Test.....	85
4.3 Intepretasi Hasil	92
4.3.1 Pengujian Hipotesis 1	92
4.3.2 Pengujian Hipotesis 2	93
4.3.3 Pengujian Hipotesis 3	94
4.3.4 Pengujian Hipotesis 4	95
4.3.5 Pengujian Hipotesis 5	96
4.3.6 Pengujian Hipotesis 6	97
4.3.7 Pengujian Hipotesis 7	98
4.3.8 Pengujian Hipotesis 8	99
4.3.9 Pengujian Hipotesis 9	99
4.3.10 Pengujian Hipotesis 10	100
BAB V PENUTUP	102
5.1 Kesimpulan	102
5.2 Keterbatasan.....	103
5.3 Saran.....	104
DAFTAR PUSTAKA	106

LAMPIRAN 109