

## DAFTAR ISI

**HALAMAN JUDUL**

**SK PENUNJANG PEMBIMBING**

**HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI**

**ABSTRAK**..... i

**KATA PENGANTAR**..... ii

**DAFTAR ISI** ..... vi

**DAFTAR TABEL** ..... x

**DAFTAR GAMBAR** ..... xii

**BAB I : PENDAHULUAN**

1.1 LatarBelakangMasalah ..... 1

1.2 PerumusanMasalah ..... 6

1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian ..... 7

1.4 Sistematika Penulisan ..... 8

**BAB II : TELAAH PUSTAKA DAN HIPOTESIS**

2.1 Telaah Pustaka ..... 10

2.1.1 Teori Portofolio Modern ..... 10

2.1.2 Teori Dow atau The Dow Theory .....	10
2.1.3 Teori CAPM (Capital Asset Pricing Model) .....	11
2.1.4 Saham .....	11
2.1.5 Indeks Harga Saham.....	13
2.1.6 Pengertian Investasi.....	15
2.1.7 Risiko saham .....	16
2.2 Pengaruh Asset Growth, asset size, Likuiditas, ROA dan ROE terhadap Risiko Sistemik .....	24
2.2.1 Pengaruh Asset Growth terhadap Risiko Sistemik ....	24
2.2.2 Pengaruh Asset Size terhadap Risiko Sistemik.....	26
2.2.3 Pengaruh Likuiditas terhadap Risiko Sistemik .....	27
2.2.4 Pengaruh ROA terhadap Risiko Sistemik .....	28
2.2.5 Pengaruh ROE terhadap Risiko Sistemik .....	29
2.3 Penelitian Terdahulu .....	31
2.4 Kerangka Pemikiran .....	33
2.5 Hipotesis .....	33

### **BAB III : METODE PENELITIAN**

3.1 Metode Penelitian .....	34
3.2 Lokasi Penelitian .....	34
3.3 Operasional Variabel .....	34
3.4 Populasi dan Sampel .....	36
3.5 Jenis dan Sumber Data .....	37

3.6 Teknik Pengumpulan Data ..... 38

3.7 Teknik Analisis Data ..... 38

#### **BAB IV : GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN (OBJEK PENELITIAN)**

4.1 Sejarah Singkat Bursa Efek Indonesia ..... 45

4.2 Visi dan Misi Bursa Efek Indonesia ..... 47

4.3 Sejarah Singkat Jakarta Islamic Indeks ..... 48

4.4 Gambaran Umum Perusahaan yang Terdaftar di JII ..... 51

#### **BAB V : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

5.1 Analisis Deskriptif ..... 74

5.2 Analisis Data ..... 84

5.3 Uji Normalitas Data ..... 84

5.4 Uji Asumsi Klasik ..... 86

5.4.1. Uji Multikolinieritas..... 87

5.4.2. Uji Heteroskedastisitas ..... 88

5.4.3. Uji Autokorelasi..... 89

5.5 Pengaruh Regresi Linier Berganda..... 90

5.6 Analisis Koefisien Determinasi ..... 93

5.7 Pengujian Hipotesis ..... 94

5.7.1 Pengujian Secara Parsial ..... 94

5.7.2 Pengujian Secara Simultan ..... 97

5.8	Pembahasan .....	99
5.8.1	Pengaruh Asset Growth terhadap Risiko Sistemik .	99
5.8.2	Pengaruh Asset Size terhadap Risiko Sistemik .....	101
5.8.3	Pengaruh Likuiditas terhadap Risiko Sistemik .....	103
5.8.4	Pengaruh ROA terhadap Risiko Sistemik .....	105
5.8.5	Pengaruh ROE terhadap Risiko Sistemik .....	106

## **BAB VI: PENUTUP**

6.1	Kesimpulan .....	107
6.2	Keterbatasan Penelitian .....	108
6.3	Saran .....	108

<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	109
-----------------------------	-----

## **LAMPIRAN-LAMPIRAN**

## **RIWAYAT HIDUP SINGKAT PENULIS**

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Rata-rata Beta, Asset Growth, Asset Size, Current Ratio, ROA dan ROE .....	4
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	31
Tabel 3.1 Operasional Variabel .....	34
Tabel 3.2 Daftar Nama Perusahaan yang di Teliti .....	37
Tabel 5.1 Perkembangan Rata-rata Asset Growth .....	75
Tabel 5.2 Perkembangan Rata-rata Asset Size.....	77
Tabel 5.3 Perkembangan Rata-rata Likuiditas (Curren Ratio).....	79
Tabel 5.4 Perkembangan Rata-rata ROA .....	80
Tabel 5.5 Perkembangan Rata-rata ROE .....	81
Tabel 5.6 Perkembangan Rata-rata Beta Saham .....	83
Tabel 5.7 Hasil Perhitungan Multikolinearitas.....	87
Tabel 5.8 Hasil Uji Autokorelasi (Uji Durbin Watson) .....	90
Tabel 5.9 Analisis Regresi Linier Berganda .....	91
Tabel 5.10 Hasil Perhitungan Koefisien Determinasi .....	93
Tabel 5.11 Hasil Analisis Uji t .....	95



Tabel 5.12 Hasil Analisis Uji F ..... 98



Dokumen ini adalah Arsip Milik :  
**Perpustakaan Universitas Islam Riau**

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 5.1 Grafik P-Plot.....	85
Gambar 5.2 Grafik Histogram .....	86
Gambar 5.3 Scaterplot .....	88

