

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRACT.....	v
ABSTRAK	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	10
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	10
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	11
1.4 Sistematika Penulisan	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	13
2.1 Landasan Teori	13
2.1.1 Teori Signal (<i>Signalling Theory</i>).....	13
2.1.2 Bank.....	14
2.1.3 Risiko Keuangan Bank	17
2.1.3.1 Risiko Kredit	17
2.1.3.2 Risiko Pasar	19
2.1.3.3 Risiko Likuiditas	20
2.1.3.4 Risiko Modal	22
2.1.4 Ukuran Perusahaan atau Ukuran Bank	24

2.1.5 Saham dan <i>Return</i> Saham	24
2.2 Penelitian Terdahulu	26
2.3 Kerangka Pemikiran	33
2.4 Hipotesis	37
2.4.1 Pengaruh Risiko Kredit terhadap <i>Return</i> Saham	37
2.4.2 Pengaruh Risiko Pasar terhadap <i>Return</i> Saham.....	38
2.4.3 Pengaruh Risiko Likuiditas terhadap <i>Return</i> Saham	40
2.4.4 Pengaruh Risiko Modal terhadap <i>Return</i> Saham.....	41
2.4.5 Pengaruh Risiko Kredit terhadap <i>Return</i> Saham dengan Ukuran Perusahaan sebagai Variabel Moderating	42
2.4.6 Pengaruh Risiko Pasar terhadap <i>Return</i> Saham dengan Ukuran Perusahaan sebagai Variabel Moderating	44
2.4.7 Pengaruh Risiko Likuiditas terhadap <i>Return</i> Saham dengan Ukuran Perusahaan sebagai Variabel Moderating	45
2.4.8 Pengaruh Risiko Modal terhadap <i>Return</i> Saham dengan Ukuran Perusahaan sebagai Variabel Moderating	46
BAB III METODE PENELITIAN.....	49
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	49
3.1.1 Variabel Dependen	49
3.1.2 Variabel Independen	50
3.1.2.1 Risiko Kredit	50
3.1.2.2 Risiko Pasar	51
3.1.2.3 Risiko Likuiditas	52
3.1.2.4 Risiko Modal	52
3.1.3 Variabel Moderate	53
3.2 Populasi dan Sampel.....	55
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	56
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	56
3.5 Metode Analisis	56
3.5.1 Statistik Deskriptif	56
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	57
3.5.2.1 Uji Normalitas	57
3.5.2.2 Uji Autokorelasi	58
3.5.2.3 Uji Multikolonieritas	59
3.5.2.4 Uji Heteroskedastisitas	59

3.5.3	Pengujian Hipotesis Penelitian	60
3.5.3.1	Analisis Regresi Moderasi.....	60
3.5.3.2	Uji Signifikansi Simultan F	61
3.5.3.3	Koefisien Determinasi	62
3.5.3.4	Uji Signifikan Parameter (Uji Statistik t)	62
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		64
4.1	Deskripsi Objek Penelitian	64
4.2	Analisis Data.....	66
4.2.1	Analisis Deskriptif	66
4.2.2	Hasil Uji Asumsi Klasik	78
4.2.2.1	Uji Normalitas	78
4.2.2.2	Uji Autokorelasi	79
4.2.2.3	Uji Multikolinearitas	80
4.2.2.4	Uji Heteroskedastisitas	81
4.2.3	Uji Hipotesis	83
4.2.3.1	Uji Signifikansi Simultan F	83
4.2.3.2	Uji Koefisien Determinasi (R^2)	84
4.2.3.3	Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t)	85
4.3	Interpretasi Hasil.....	88
4.3.1	Pengaruh Risiko Kredit terhadap <i>Return Saham</i>	88
4.3.2	Pengaruh Risiko Pasar terhadap <i>Return Saham</i>	91
4.3.3	Pengaruh Risiko Likuiditas terhadap <i>Return Saham</i>	93
4.3.4	Pengaruh Risiko Modal terhadap <i>Return Saham</i>	94
4.3.5	Ukuran Perusahaan sebagai Pemoderasi antara Risiko Kredit dengan <i>Return Saham</i>	96
4.3.6	Ukuran Perusahaan sebagai Pemoderasi antara Risiko Pasar dengan <i>Return Saham</i>	98
4.3.7	Ukuran Perusahaan sebagai Pemoderasi antara Risiko Likuiditas dengan <i>Return Saham</i>	99
4.3.8	Ukuran Perusahaan sebagai Pemoderasi antara Risiko Modal dengan <i>Return Saham</i>	101
BAB V PENUTUP.....		103
5.1	Kesimpulan	103
5.2	Keterbatasan.....	104
5.3	Saran	104

DAFTAR PUSTAKA	106
LAMPIRAN.....	109

