DAFTAR ISI

Halaman Judul i
Halaman Pengesahan ii
Pernyataan Orisinalitas Skripsi iv
Declaration v
Kata Pengantar vi
Abstrak ix
Abstract x
Abstrak Bahasa Arab xi
Pedoman Transliterasi Arab-Latin xii
DAFTAR ISI xv
DAFTAR TABEL xvii
DAFTAR GAMBAR. xviii
DAFTAR LAMPIRAN. xix
BAB 1 PENDAHULUAN 1
1.1.Latar Belakang 1
1.2.Rumusan Masalah 12
1.3.Tujuan Penelitian 12
1.4.Manfaat Penelitian 13
1.5.Sistematika Penulisan 14
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA 16
2.1.Landasan Teori 16
2.1.1.Pasar Modal 16
2.1.2.Investasi 19
2.1.3.Struktur Modal 19
2.1.3.1. Utang dalam Perspektif Islam 24
2.1.3.2. Modal dalam Islam 26
2.1.4.Profitabilitas 26
2.1.5.Return Saham 27
2.2. Pengaruh Antar Variabel 29
2.2.1 Pengaruh Struktur Modal Terhadap Profitabilitas Perusahaan 29
2.2.2Pengaruh Profitabilitas terhadap Return Saham 31
2.2.3Pengaruh Struktur Modal terhadap Return Saham 32
2.3. Penelitian Sebelumnya 33
2.4 Hipotesis dan Model Analisis 35
2.4.1Hipotesis 35
2.4.2Model Analisis 35
2.5 Kerangka Berpikir 36
BAB 3 METODE PENELITIAN 38
3.1 Pendekatan Penelitian 38
3.2 Identifikasi Variabel 38
3.3 Definisi Operasional Variabel 39
3.3.1Debt to Equity Ratio (DER) 39

3.3.2Return On Equity (ROE) 39
3.3.3Return Saham 39
3.4. Jenis dan Sumber Data 40
3.5. Populasi dan Sampel 40
3.6 Teknik Analisis 41
3.6.1Diagram Jalur Model Penelitian Empiris 42
3.6.2Asumsi Klasik 46
3.6.2.1Uji Normalitas 46
3.6.2.2Uji Multikolinieritas 46
3.6.3Pengujian Hipotesis 47
3.6.3.1Uji T 47
3.6.3.2Uji Koefisien Determinasi (R^2) 47
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN 49
4.1 Gambaran Umum *Jakarta Islamic Index* (JII) 49
4.2 Deskripsi Hasil Penelitian 51
4.2.1Statistik Deskriptif *Debt to Equity Ratio* (DER) 52
4.2.2Statistik Deskriptif *Return On Equity* (ROE) 54
4.2.3Statistik Deskriptif *Return* Saham 55
4.3 Analisis Model dan Pembuktian Hipotesis 56
4.3.1Uji Asumsi Klasik 56
4.3.1.1Uji Normalitas 56
4.3.1.2Uji Multikolinearitas 58
4.3.2Analisis Jalur 59
4.3.2.1Koefisien Determinasi (R^2) dan Uji t 59
4.3.2.2Pengaruh Langsung dan Tidak Langsung 63
4.3.2.3*Path Diagram* 64
4.3.3Pengujian Hipotesis 64
4.4 Pembahasan 66
4.4.1Pengaruh Struktur Modal terhadap Profitabilitas Perusahaan 66
4.4.2Pengaruh Profitabilitas terhadap *Return* Saham 70
4.4.3Pengaruh Struktur Modal terhadap *Return* Saham 73
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN 78
5.1 Simpulan 78
5.2 Saran 79
DAFTAR PUSTAKA 81
Lampiran 83

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Penelitian Sebelumnya	34
Tabel 3.1	Pengaruh Langsung dan Tidak Langsung dari Variabel Independen terhadap Variabel Dependen yang Dimediasi Oleh Variabel *Intervening*	44
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif Sampel Perusahaan Periode 2009-2013	52
Tabel 4.2	DER Perusahaan Manufaktur di JII Tahun 2009-2013	53
Tabel 4.3	ROE Perusahaan Manufaktur di JII Tahun 2009-2013	54
Tabel 4.4	Return Saham Perusahaan Manufaktur di JII Tahun 2009-2013	56
Tabel 4.5	One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test	57
Tabel 4.6	Uji Multikolinearitas Coefficients	59
Tabel 4.7	Model Summary	59
Tabel 4.8	Coefficients	60
Tabel 4.9	Model Summary	61
Tabel 4.10	ANOVA	62
Tabel 4.11	Coefficients	62
Tabel 4.12	Pengaruh Langsung dan Tidak Langsung dari Variabel Independen terhadap Variabel Dependen yang Dimediasi oleh Variabel *Intervening*	63

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Proyeksi Nilai Pertumbuhan PDB Indonesia oleh IMF 1
Gambar 2.1 Diagram Jalur Hubungan Kausal Struktur Modal Terhadap Profitabilitas Dan Return Saham 36
Gambar 2.2 Kerangka Berpikir 37
Gambar 3.1 Diagram Jalur Model Penelitian Empiris: Struktur Modal, Return Saham, dan Mediasi Profitabilitas 42
Gambar 4.1 *Path Diagram* 64

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Tabulasi

Lampiran 2 : output SPSS