

DAFTAR ISI

Halaman

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO	v
<i>Abstract</i>	vi
Abstrak	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	15
1.3 Tujuan Penelitian	16
1.4 Manfaat Penelitian	16
1.5 Sistematika Penulisan	16
BAB II	19
TINJAUAN PUSTAKA	19
2.1 Landasan Teori	19
2.1.1 Beta Saham	19
2.1.2 CAPM	22
2.1.3 Return Defensive Stocks	23
2.1.4 PROFITABILITAS (ROE)	25
2.1.5 Firm Size	27
2.1.6 <i>Current ratio</i>	28
2.1.7 DER	29
2.2 Penelitian Terdahulu	31

2.3 Pengaruh Variabel Independen Terhadap Variabel Dependen dan Hipotesis	38
2.3.1 Pengaruh ROE terhadap <i>Return Defensive Stocks</i> dan Hipotesis	38
2.3.2 Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap <i>Return Defensive Stocks</i> dan Hipotesis.....	39
2.3.3 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return Defensive Stocks</i> dan Hipotesis	40
2.3.4 Pengaruh DER terhadap <i>Return Defensive Stocks</i> dan Hipotesis	40
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis	41
2.5 Pengembangan Hipotesis	42
BAB III	43
METODE PENELITIAN.....	43
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	43
3.1.1 Variabel Penelitian.....	43
3.1.2 Definisi Operasional	44
3.1.2.1 ROE.....	44
3.1.2.2 Firm Size	45
3.1.2.3 Current Ratio.....	45
3.1.2.4 DER.....	46
3.1.2.5 Return defensive stocks	46
3.2 Populasi dan sampel.....	48
3.2.1 Populasi.....	48
3.2.2 Sampel.....	48
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	50
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	50
3.5 Metode Analisis	51
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	51
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	52
3.5.2.1 Uji Normalitas.....	52
3.5.2.2 Uji Multikolonieritas.....	53
3.5.2.3 Uji Autokorelasi.....	54
3.5.2.4 Uji Heteroskeditas.....	55
3.5.3 Uji Hipotesis Analisis Regresi Linier Berganda	56
3.5.3.1 Uji Statistik F	56

3.5.3.2	Uji Statistik t	57
3.5.3.3	Uji Koefisien Determinasi	58
BAB IV	59
HASIL DAN PEMBAHASAN	59
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	59
4.2	Statistik Deskriptif	60
4.3	Analisis Data	63
4.3.1	Uji Asumsi Klasik.....	64
4.3.1.1	Uji Normalitas.....	64
4.3.1.2	Uji Multikolinearitas	66
4.3.1.3	Uji Autokolerasi.....	68
4.3.1.4	Uji Heteroskedastisitas.....	69
4.3.2	Uji Regresi Berganda.....	70
4.3.2.1	Uji Statistik F.....	70
4.3.2.2	Uji Statistik t	71
4.3.2.3	Uji Koefisien Determinasi	73
4.4	Pembahasan.....	74
4.4.1	Pembahasan Hipotesis 1.....	75
4.4.2	Pembahasan Hipotesis 2.....	76
4.4.3	Pembahasan Hipotesis 3.....	77
4.4.4	Pembahasan Hipotesis 4.....	78
BAB V	80
KESIMPULAN DAN SARAN	80
5.1	Kesimpulan	80
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	82
5.3	Saran	83
5.3.1	Saran bagi Investor.....	83
5.3.2	Saran bagi Penelitian Selanjutnya.....	83
DAFTAR PUSTAKA	85
LAMPIRAN	89
Lampiran A	89

Lampiran B	90
Lampiran C.....	94