

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	5
1.3. Tujuan Penelitian	5
1.4. Manfaat Penelitian	6
1.5. Sistematika Penulisan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1. Landasan Teori	8
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	8
2.1.2 Portofolio Saham	9
2.1.3 Risiko Saham	10

2.1.4 Beta (Risiko Sistematis)	14
2.1.5 Asset Growth	14
2.1.6 Earning Per Share (EPS)	15
2.1.7 Debt to Total Asset	15
2.1.8 Return On Investment.....	16
2.1.9 Divident Yield	16
2.2.Penelitian Terdahulu	16
2.3.Kerangka Pemikiran Teoritis dan Hipotesis	19
2.3.1 Hubungan <i>Asset Growth</i> terhadap Risiko sistematis	19
2.3.2 Hubungan Earning Per Share (EPS) terhadap Beta Saham	20
2.3.3 Hubungan <i>Debt to Total</i> terhadap Beta Saham	20
2.3.4 Hubungan ROI terhadap Beta Saham	21
2.3.5 Hubungan Dividen Yields terhadap Beta Saham	22
BAB III METODE PENELITIAN	24
3.1. Definisi Operasional Variabel	24
3.1.1 Variabel Dependen	24
3.1.2 Variabel Independen	25
3.2.Populasi dan Sampel	26
3.3.Jenis dan Sumber Data	30
3.4.Metode Pengumpulan Data	30
3.5.Metode Analisis	30
3.5.1 Statistik Deskriptif	30
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	31

3.5.3 Uji Goodness of Fit	34
3.5.4 Persamaan Garis Regresi	38
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	40
4.1. Deskripsi Obyek Penelitian	40
4.2.Deskriptif Variabel Penelitian	44
4.3.Pengujian Normalitas	45
4.4.Pengujian Asumsi Klasik	45
4.4.1Uji Heteroskedastisitas	46
4.4.2 Uji Multikolinearitas	47
4.4.3 Uji Autokorelasi	48
4.5.Analisa Hipotesis	49
4.5.1 Regresi Linier Berganda	49
4.5.2 Analisa Koefisien Determinasi	51
4.5.3 Uji Hipotesis	52
4.6.Pembahasan	56
BAB V PENUTUP	59
5.1 Simpulan	59
5.2 Keterbatasan Penelitian	60
5.3 Implikasi	61
5.4 Saran	61

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN