

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR GRAFIK.....	xiv
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	13
1.3.1 Tujuan Penelitian	13
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	13
1.4 Sistematika Penulisan.....	14
BAB II TELAAH PUSTAKA	15
2.1 Landasan Teori dan.....	15
2.1.1 Pasar Modal Sebagai Sarana Investasi.....	15
2.1.2 Teori <i>Efficient Market</i>	16
2.1.3 Investasi Saham.....	18
2.1.4 Return Saham.....	20
2.1.5 Risiko Investasi	23
2.1.6 Hubungan Antara <i>Return</i> dan Risiko.....	24

2.1.7	Risiko Pasar (Beta).....	25
2.1.8	Ukuran Perusahaan.....	26
2.1.9	Rasio <i>Book to Market Equity</i>	28
2.1.10	Rasio <i>Leverage</i>	30
2.2	Penelitian Terdahulu	33
2.3	Kerangka Pemikiran.....	40
2.4	Hipotesis Penelitian.....	41
2.4.1	Risiko Pasar (Beta).....	41
2.4.2	Ukuran Perusahaan.....	42
2.4.3	Rasio <i>Book To Market Equity</i>	43
2.4.4	Rasio <i>Leverage</i>	44
BAB III METODE PENELITIAN.....		46
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	46
3.1.1	Variabel Dependen.....	46
3.1.2	Variabel Independen	47
3.1.2.1	Risiko Pasar (Beta).....	47
3.1.2.2	Ukuran Perusahaan	49
3.1.2.3	Rasio <i>Book-to-Market Equity</i>	49
3.1.2.4	Rasio <i>Leverage</i>	50
3.2	Populasi dan Sampel	50
3.3	Jenis dan Sumber Data	51
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	52
3.5	Metode Analisis Data.....	53
3.5.1	Uji Asumsi Klasik	53
3.5.1.1	Uji Normalitas.....	53
3.5.1.2	Uji Multikolonieritas.....	54
3.5.1.3	Uji Autokorelasi	55
3.5.1.4	Uji Heteroskedastisitas.....	55
3.5.2	Analisis Regresi Berganda	56
3.5.3	Uji Hipotesis.....	57

3.5.3.1	Uji Parsial (t test)	57
3.5.3.2	Uji Pengaruh Simultan (F test).....	58
3.5.3.3	Koefisien Determinasi (R^2).....	58
BAB IV HASIL DAN ANALISIS		59
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	59
4.2	Analisis Data dan Pembahasan	59
4.2.1	Deskripsi Variabel Penelitian.....	59
4.2.2	Uji Asumsi Klasik	61
4.2.2.1	Uji Normalitas.....	61
4.2.2.2	Uji Multikolonieritas.....	65
4.2.2.3	Uji Autokorelasi.....	67
4.2.2.4	Uji Heteroskedastisitas.....	68
4.2.3	Uji Hipotesis.....	70
4.2.3.1	Hasil Uji Hipotesis Pertama	72
4.2.3.2	Hasil Uji Hipotesis Kedua.....	72
4.2.3.3	Hasil Uji Hipotesis Ketiga	73
4.2.3.4	Hasil Uji Hipotesis Keempat.....	73
4.2.4	Hasil Uji Pengaruh Simultan (F test)	73
4.2.5	Koefisien Determinasi (R^2).....	74
4.2.6	Pembahasan.....	75
BAB V PENUTUP.....		81
5.1	Kesimpulan	81
5.2	Keterbatasan.....	82
5.3	Saran.....	83

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN