

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	7
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1 Landasan Teori	9
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu	18
2.3 Perumusan Hipotesis	21
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
3.1 Metode Pengumpulan Data	23
3.1.1 Jenis dan sumber data.....	23
3.1.2 Sampel.....	25
3.2 Metode Analisis.....	26
3.2.1 Model empiris	27
3.2.2 Perhitungan <i>return</i>	33
3.2.3 Pengujian Asumsi Klasik	36

3.2.4	Pengujian hipotesis	40
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		42
4.1	Pembentukan Portofolio	42
4.2	Uji Asumsi Klasik	45
4.2.1	Uji heteroskedastisitas.....	45
4.2.2	Uji autokorelasi	46
4.3	Uji Hipotesis.....	47
4.3.1	Uji t	47
4.3.2	Uji koefisien determinasi (R^2).....	49
BAB V SIMPULAN		53
5.1	Simpulan.....	53
5.2	Implikasi	54
5.3	Keterbatasan	55
5.4	Saran.....	55
DAFTAR PUSTAKA		56
LAMPIRAN.....		59

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Jumlah Perusahaan dalam Portofolio per Tahun.....	42
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Model Input	43
Tabel 4.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas Metode Breusch-Pagan-Godfrey	46
Tabel 4.4 Hasil Uji Autokorelasi dengan Metode Breusch-Godfrey <i>Serial</i> <i>Correlation Lagrange Multiplier</i>	47
Tabel 4.5 Hasil Regresi Linier Ketiga Model	48
Tabel 4.6 Perbandingan Nilai R^2 Ketiga Model.....	51

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Risiko Portofolio	12
Gambar 3.1 Opsi Investasi yang Melibatkan Satu Saham	32

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.A Daftar Perusahaan sebagai Sampel Penelitian (1 dari 4)	59
Lampiran 1.B Daftar Perusahaan sebagai Sampel Penelitian (2 dari 4)	60
Lampiran 1.C Daftar Perusahaan sebagai Sampel Penelitian (3 dari 4)	61
Lampiran 1.D Daftar Perusahaan sebagai Sampel Penelitian (4 dari 4)	62