

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
PRAKATA	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Identifikasi Permasalahan.....	7
1.3. Pembatasan Permasalahan.....	8
1.4. Perumusan Permasalahan.....	9
1.5. Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	10
1.6. Organisasi Penulisan.....	10
BAB II KAJIAN TEORITIS	12
2.1. Pasar Modal.....	12
2.2. Efficient Market Hypothesis.....	14

2.3.	Hubungan Antara Return dan Resiko Investasi.....	17
2.4.	Capital Asset Pricing Model.....	21
2.5.	Kontradiksi Terhadap Capital Asset Pricing Model.....	24
2.5.1.	Penelitian Terdahulu di Negara Maju.....	24
2.5.2.	Penelitian Terdahulu di Emerging Market.....	27
2.5.3.	Penelitian Terdahulu di Indonesia.....	27
BAB III	METODOLOGI PENELITIAN.....	29
3.1.	Jenis Penelitian.....	29
3.2.	Peubah dan definisi Operasional Peubah.....	30
3.2.1.	Return.....	30
3.2.2.	Beta.....	31
3.2.3.	Price Earning Ratio (PER).....	31
3.2.4.	Price to Book Value (PBV).....	32
3.2.5.	Firm Size.....	32
3.3.	Sumber Data.....	32
3.4.	Target dan Karakteristik Sampel.....	33
3.5.	Prosedur dan Instrumen Pengambilan Data.....	33
3.6.	Metode Pengolahan Data.....	34
3.6.1.	Statistik Deskriptif.....	35
3.6.2.	Statistik Inferensi.....	35
3.6.3.	Analisis Regresi Logistik.....	36
BAB IV	ANALISIS DATA.....	39
4.1.	Analisis Statistik Deskriptif.....	39

4.2.	Analisis Regresi Binary Logistik.....	42
4.2.1.	Analisis Ketepatan Model.....	42
4.2.2.	Analisis Hasil Klasifikasi.....	43
4.2.3.	Analisis Multikolinearitas.....	44
4.2.4.	Analisis Koefisien	45
BAB V	KESIMPULAN DAN IMPLIKASI.....	52
5.1.	Kesimpulan.....	52
5.2.	Implikasi.....	53
	DAFTAR PUSTAKA.....	55