

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN .....	iv
KATA PENGANTAR .....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	vi
INTISARI.....	vii
<i>ABSTRACT</i> .....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
<b>BAB I. PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	10
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	11
1.4 Tujuan Penelitian.....	11
1.5 Motivasi Penelitian.....	11
1.6 Manfaat Penelitian.....	12
1.7 Kontribusi Penelitian.....	12
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	13
1.9 Sistematika Penulisan.....	14
<b>BAB II. LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>16</b>
2.1 Landasan Teori .....	16
2.1.1 Saham dan return.....	16
2.1.2 Indeks LQ45.....	18
2.1.3 Risiko investasi saham .....	20
2.1.4 Beta .....	22
2.1.5 Bias pada beta .....	25
2.1.6 Metode koreksi beta .....	27
2.1.7 Periode <i>lag-lead</i> .....	28

2.2	Tinjauan Pustaka .....	29
2.3	Hipotesis .....	32
2.3.1	Kebiasaan beta di indeks LQ45 .....	32
2.3.2	Metode pengoreksian beta terbaik .....	34
<b>BAB III. METODE PENELITIAN .....</b>		<b>35</b>
3.1	Desain Penelitian .....	35
3.2	Definisi Operasional Variabel .....	35
3.2.1	Return saham dan return indeks .....	35
3.2.2	Beta saham dan beta indeks .....	36
3.3	Populasi dan Sampel .....	37
3.4	Instrumen Penelitian .....	38
3.5	Teknik Pengumpulan Data .....	38
3.6	Teknik Analisis Data .....	39
3.6.1	Uji hipotesis 1 .....	39
3.6.2	Uji hipotesis 2 .....	41
<b>BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>46</b>
4.1	Deskripsi Data .....	46
4.2	Pengujian Hipotesis .....	46
4.2.1	Uji hipotesis 1 .....	46
4.2.2	Uji hipotesis 2 .....	48
4.3	Pembahasan .....	52
<b>BAB V. SIMPULAN .....</b>		<b>58</b>
5.1	Simpulan.....	58
5.2	Keterbatasan .....	59
5.3	Saran .....	59
5.4	Implikasi .....	59
DAFTAR PUSATAKA .....		61
LAMPIRAN.....		65