

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
ABSTRAKSI	iv
INTISARI.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Permasalahan	6
1.3. Batasan Masalah	6
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.6. Sistematika Penelitian	8
BAB II TINJAUAN LITERATUR DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	9
2.1. Imbal Hasil (Return)	9
2.2. Risiko (Risk)	11
2.3. Koefisien Beta (β)	12
2.4. Diversifikasi Risiko	16
2.5. Capital Asset Pricing Model (CAPM)	18
2.6. Pasar Modal Indonesia	20
2.7. Definisi Saham	22
2.8. <i>Interval Effect</i> dan Perumusan Hipotesis	25
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	29
3.1. Lingkup Penelitian	29
3.2. Kriteria Sampel	30

3.3.	Pengumpulan Data	31
3.4.	Tahapan Penelitian	32
BAB IV	ANALISA HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	36
4.1.	Data Penelitian	36
4.2.	Return Harian, Mingguan dan Bulanan	36
4.3.	Return Market (Pasar)	42
4.4.	Beta Saham	43
4.5.	Standar Deviasi Beta	49
BAB V	SIMPULAN DAN SARAN	52
5.1.	Simpulan	52
5.2.	Saran	53

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN – LAMPIRAN