

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	Halaman
HALAMAN PENGESAHAN	i
PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR GAMBAR	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
1. Perumusan Masalah	3
2. Pembatasan Masalah	3
B. Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1. Tujuan Penelitian	4
2. Manfaat Penelitian	5
C. Sistematika Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Tinjauan Pustaka	8
B. Landasan Teori dan Pengembangan Hipotesis	17
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Materi Penelitian	25
1. Objek Penelitian	25
2. Metoda pengumpulan data	26
3. Variabel Penelitian	27
4. Pengukuran Variabel Penelitian	28
B. Pengujian Asumsi	30
1. Uji Normalitas	30
2. Uji Asumsi Regresi	30

C. Teknik Analisis Data	32
D. Pengujian Hipotesis	33
BAB IV ANALISIS DATA	
A. Deskripsi Umum Hasil Penelitian	34
1. Beta Saham	34
2. Likuiditas	36
3. <i>Financial Leverage</i>	38
4. <i>Return on Equity</i>	39
5. Variabel Makro	40
B. Pengujian Asumsi	41
1. Uji Normalitas	41
2. Uji Asumsi Regresi	42
a. <i>Multicolinieritas</i>	42
b. <i>Heteroskedastisitas</i>	44
c. <i>Autokorelasi</i>	45
C. Analisis Regresi Linier Berganda.	
1. Analisis Regresi Berganda antara Beta dengan Variabel Fundamental	46
2. Analisis Regresi Berganda antara Beta dengan Variabel Makro	49
3. Perbandingan <i>Multiple R</i> dan <i>Adjusted R Square</i> antara Variabel Fundamental dan Variabel Makro	51
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan	55
B. Keterbatasan dan Saran	56
DAFTAR PUSTAKA	58

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Risiko Total, Risiko Sistematis, Risiko Tidak Sistematis	9
Gambar 2.2 Model Indeks Tunggal	13

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 3.1 12 Perusahaan yang Menjadi Sampel	26
Tabel 4.1 Hasil Perhitungan Beta Saham 12 Perusahaan LQ45 pada Tahun 2003-2007	35
Tabel 4.2 Hasil Perhitungan <i>Current Ratio</i> 12 Perusahaan LQ45 pada Tahun 2003-2007	36
Tabel 4.3 Hasil Perhitungan <i>Financial Leverage</i> 12 Perusahaan LQ45 pada Tahun 2003-2007 dalam persen	38
Tabel 4.4 Hasil Perhitungan <i>Return on Equity</i> 12 Perusahaan LQ45 pada Tahun 2003-2007 dalam persen	39
Tabel 4.5 Data Variabel Makro (Tingkat Infalasi, Nilai Tukar Valuta Asing, PDB) pada Tahun 2003-2007 dalam persen	41
Tabel 4.6 Hasil Uji Normalitas	42
Tabel 4.7 Hasil Uji <i>Multicolinieritas</i> Variabel Fundamental	43
Tabel 4.8 Hasil Uji <i>Multicolinieritas</i> Variabel Makro	43
Tabel 4.9 Hasil Uji <i>Heteroskedastisitas</i> Variabel Fundamental	44
Tabel 4.10 Hasil Uji <i>Heteroskedastisitas</i> Variabel Marko	45
Tabel 4.11 Pengaruh Variabel Fundamental terhadap Risiko Sistematis (Beta) pada Perusahaan LQ45 yang terdaftar di BEJ	47
Tabel 4.12 Pengaruh Variabel Makro terhadap Risiko Sistematis (Beta) pada Perusahaan LQ45 yang terdaftar di BEJ	49
Tabel 4.13 Perbandingan <i>Multiple R</i> dan <i>Adjusted R Square</i> antara Variabel Fundamental dan Variabel Makro	52

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Data Beta, Variabel Fundamental dan Variabel Makro Tahun 2003-2007	59
Lampiran 2	Uji Normalitas	60
Lampiran 3	Uji Multikolinearitas: Variabel Fundamental	61
Lampiran 4	Uji Multikolinearitas: Variabel Makro	62
Lampiran 5	Uji Heteroskedastisitas: Variabel Fundamental	63
Lampiran 6	Uji Heteroskedastisitas: Variabel Makro	64
Lampiran 7	Uji Autokorelasi: Variabel Fundamental	65
Lampiran 8	Uji Autokorelasi: Variabel Makro	66
Lampiran 9	Regression: Variabel Fundamental	67
Lampiran 10	Regression: Variabel Makro	68