UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Teori Prospek dan Hubungan Risiko dan Return pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks Kompas100
I Putu Soma Rolandwika, I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.,
Universitas Gadjah Mada, 2019 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR ISI

Halaman Judul i
Halaman Pengesahan ii
Halaman Persetujuan iii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis iv
Kata Pengantar v
Daftar Isi vii
Daftar Tabel x
Daftar Bagan xi
Daftar Lampiran xii
Intisari xiii
Abstract xiv
BAB I PENDAHULUAN 1
1.1 Latar Belakang Masalah 1
1.2 Rumusan Masalah 4
1.3 Pertanyaan Penelitian 5
1.4 Tujuan Penelitian 5
1.5 Manfaat Penelitian 6
1.6 Ruang Lingkup Penelitian 6
1.7 Sistematika Penulisan 7
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS 9
2.1 Landasan Teori 9
2.1.1 Keuangan Keperilakuan 9
2.1.2 Teori Prospek 11
2.2 Penelitian Terdahulu 15
2.3 Pengembangan Hipotesis 19

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Teori Prospek dan Hubungan Risiko dan Return pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks Kompas100
I Putu Soma Rolandwika, I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.,
Universitas Gadjah Mada, 2019 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

BAB III METODE PENELITIAN 22
3.1 Data dan Sampel Penelitian 22
3.1.1 Data Penelitian 22
3.1.2 Sampel Penelitian 23
3.2 Definisi Operasional 23
3.2.1 Risiko Perusahaan (RISK) 24
3.2.2 Return on Equity (ROE) 25
3.2.3 *Leverage* Perusahaan (DER) 25
3.2.4 Ukuran Perusahaan (SIZE) 26
3.2.5 Umur Perusahaan (AGE) 26
3.3 Model Pengujian Hipotesis 27
3.3.1 Penentuan Titik Referensi 27
3.3.2 Model Penelitian 28
3.4 Uji Asumsi Klasik 30
3.4.1 Uji Normalitas 30
3.4.2 Uji Multikolinearitas 31
3.4.3 Uji Autokorelasi 31
3.4.4 Uji Heteroskedastisitas 31
3.5 Pemilihan Model Regresi 31
3.5.1 Uji Chow 33
3.5.2 Uji Hausman 33
3.5.3 Uji Lagrange Multiple 34
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 35
4.1 Deskripsi Data 35
4.2 Uji Asumsi Klasik 39

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Teori Prospek dan Hubungan Risiko dan Return pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks Kompas100
I Putu Soma Rolandwika, I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.,
Universitas Gadjah Mada, 2019 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

4.2.1 Uji Normalitas 40
4.2.2 Uji Multikolinearitas 40
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas 42
4.2.4 Uji Autokorelasi 43
4.3 Pemilihan Model Regresi Data Panel 44
4.3.1 Uji Chow 45
4.3.2 Uji Hausman 46
4.4 Pengujian Hipotesis 47
4.4.1 Pengujian Hipotesis 1 47
4.4.2 Pengujian Hipotesis 2 51
4.4.3 Pengujian Hipotesis 3 55
BAB V SIMPULAN 56
5.1 Simpulan 56
5.2 Keterbatasan 59
5.3 Implikasi 60
5.4 Saran 61
DAFTAR PUSTAKA 62
LAMPIRAN 63