

Lembar judul.....	i
Lembar pengesahan.....	ii
Lembar pernyataan.....	iii
Kata pengantar	iv
Daftar isi	v
Daftar Tabel	vii
Daftar Gambar	viii
Intisari.....	ix
Abstract	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	6
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Batasan Penelitian.....	8
1.7. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI.....	11
2.1. Kelompok Industri	11
2.2. Risiko Sistematis	12
2.2.1. Single Indeks Model	14

2.1.2. Tingkat Pengembalian Super	15
2.2.3. Tingkat Pengembalian Pasar	16
2.3. Variabel yang mempengaruhi risiko sistematis	17
2.4. Hasil Penelitian Terdahulu	21
2.5. Kerangka Penelitian	22
BAB III METODA PENELITIAN	27
3.1. Rancangan Penelitian	27
3.2. Sampel Penelitian	27
3.3. Pengumpulan Data	29
3.4. Analisis Data	30
BAB IV HASIL PEMBAHASAN	35
4.1. Deskripsi Data	35
4.2. Pengujian Asumsi klasik	37
4.3. Uji Signifikansi	41
4.4. Pengujian Hipotesis	43
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	35
5.1. Keterbatasan	49
5.2. Implikasi	50
5.3. Keterbatasan	50
DAFTAR PUSTAKA	51
LAMPIRAN	a-e