

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	1
HALAMAN PERNYATAAN.....	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
<i>ABSTRACT</i>	viii
INTISARI.....	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Landasan Teori.....	8
2.1.1 Investasi.....	8
2.1.2 Pasar Modal	9
2.1.3 <i>Risk and Return</i>	10
2.1.3.1 Risiko	10
2.1.3.2 <i>Return</i>	11
2.1.4 Risiko Sistematis (Beta)	12
2.1.5 Hamada <i>Equation</i>	14
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu.....	16
2.3 Model Penelitian.....	20
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1 Data dan Sampel	21
3.2 Definisi Operasional	24
3.3 Metode Analisis Data	29

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	31
4.1 Statistik Deskriptif	31
4.1.1 Semua Sektor dalam Industri Manufaktur	31
4.1.2 Industri Konsumsi	33
4.1.3 Aneka Industri	35
4.1.4 Industri Dasar Kimia.....	36
4.2 Uji Beda (<i>Paired Sample t-test.</i>).....	38
4.3 Diskusi dan Pembahasan	42
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	49
5.1 Kesimpulan.....	49
5.2 Keterbatasan	50
5.3 Saran	50
5.4 Implikasi	51
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN 1	54
LAMPIRAN 1 DAFTAR PERUSAHAAN MANUFAKTUR	54
LAMPIRAN 2 <i>OUTLIER</i>	58
LAMPIRAN 3 UJI BEDA (<i>Paired Sample t-test</i>)	62