

## DAFTAR ISI

<b>LEMBAR JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN</b> .....	<b>i</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>iii</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>v</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>viii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>ix</b>
<b>INTISARI</b> .....	<b>x</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>xi</b>
<b>BAB I</b> .....	<b>1</b>
<b>PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah .....	5
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4. Tujuan Penelitian .....	6
1.5. Manfaat Penelitian .....	6
1.6. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian .....	7
1.7. Sistematika Penelitian.....	7
<b>BAB II</b> .....	<b>9</b>
<b>LANDASAN TEORI</b> .....	<b>9</b>
2.1 Landasan Konseptual dan Pengembangan Hipotesis .....	9
2.1.1 Pengertian Investasi .....	9
2.1.2 Risiko Investasi .....	10
2.1.3 Risiko sistematis saham ( <i>Beta</i> ) Saham .....	13
2.1.4 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Risiko sistematis saham ( <i>Beta</i> ).....	14
2.2 Kerangka Konseptual.....	19
<b>BAB III</b> .....	<b>20</b>
<b>METODA PENELITIAN</b> .....	<b>20</b>
3.1 Rancangan Penelitian.....	20

3.2	Definisi Operasional .....	20
3.3	Populasi dan Sampel Penelitian .....	23
3.4	Metode Pengumpulan Data .....	25
3.4.1	Sumber dan Data yang Dihimpun .....	25
3.4.2	Teknik Pengumpulan Data .....	26
3.5	Metode Analisis Data .....	27
3.5.1	Pengujian Asumsi Klasik .....	27
3.5.2	Pengujian Hipotesis .....	30
<b>BAB IV</b>	.....	<b>33</b>
<b>HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b>	.....	<b>33</b>
4.1	Deskripsi Objek Penelitian .....	33
4.2	Statistik Deskriptif .....	33
4.3	Uji Asumsi Klasik .....	35
4.3.1	Uji Normalitas .....	35
4.3.2	Uji Multikolinearitas .....	36
4.3.3	Uji Autokorelasi .....	37
4.3.4	Uji Heterokedastisitas .....	38
4.4	Uji-F .....	40
4.5	Uji Koefisien Determinasi (Adj. R <sup>2</sup> ) .....	41
4.6	Analisis Regresi Berganda .....	42
4.7	Uji T .....	43
4.8	Pembahasan Hasil Penelitian .....	46
<b>BAB V</b>	.....	<b>52</b>
<b>KESIMPULAN DAN SARAN</b>	.....	<b>52</b>
5.1	Kesimpulan .....	52
5.2	Implikasi Manajerial .....	53
5.3	Saran Penelitian .....	53
5.4	Keterbatasan Penelitian .....	54
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	.....	<b>55</b>
<b>LAMPIRAN</b>	.....	<b>57</b>

## DAFTAR TABEL

Tabel 3.1: Kriteria Penentuan Jumlah Sample Penelitian.....	24
Tabel 3.2: Sampel Penelitian Indeks Kompas 100 Periode 2010-2014.....	25
Tabel 4.1: Descriptive Statistics.....	33
Tabel 4.2: Uji Normalitas One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test 4.....	35
Tabel 4.3: Uji Multikolinearitas.....	36
Tabel 4.4: Uji Autokorelasi.....	37
Tabel 4.5: Uji Heterokedastisitas (Uji Park).....	39
Tabel 4.6: Uji-F.....	40

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1: Security Market Line .....	12
Gambar 2.2: Skema Kerangka Konseptual .....	19
Gambar 4.2: Hasil Uji Heterokedastisitas ( <i>scatter plot</i> ) .....	39

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Daftar Perusahaan Yang Tergabung Dalam Index Kompas 100 Periode 2010 – 2014.....	57
Lampiran 2: Hasil Perhitungan <i>Beta</i> ( $\beta$ ) Saham .....	58
Lampiran 3: Hasil Perhitungan <i>Leverage</i> .....	59
Lampiran 4: Hasil Perhitungan <i>Total Assets Turnover</i> .....	70
Lampiran 5: Hasil Perhitungan <i>Growth</i> .....	61
Lampiran 6: Hasil Perhitungan <i>Dividend Payout</i> .....	62
Lampiran 7: Hasil Perhitungan <i>Liquidity</i> .....	63
Lampiran 8: Hasil Perhitungan <i>Firm Size</i> .....	64
Lampiran 9: Hasil Uji Statistik .....	64