

DAFTAR ISI

	Hal
HALAMAN JUDUL	i
LEMBARAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN	iii
PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI	xii
ABSTRAK	Xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Masalah Penelitian	3
C. Tujuan Penelitian	3
D. Manfaat Penelitian	3
E. Sistematika Pembahasan	4
BAB II TINJAUAN TEORITIS	
A. Teori Struktur Modal	6
B. Teori Agensi	8
C. Teori Sinyal	9
D. Risiko Mengikuti Perubahan Struktur Modal	11
E. Perilaku Sementara Risiko Mengikuti Perubahan Struktur Modal	18

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Sampel dan Data	20
B. Model Koreksi Bias Beta	21
C. Definisi Peristiwa Penyebab Abnormal Return	23
D. Pengujian Hipotesis	24
1. Pengujian Perubahan Risiko	24
2. Pengujian Perilaku Temporal Varians Return Saham ...	25
3. Pengujian Pengaruh Perubahan Risiko Terhadap Return	26

BAB IV HASIL PENELITIAN

A. Deskriptif Statistik	28
B. Uji Asumsi Klasik	29
1. Uji Normalitas	29
2. Uji Multikolinearitas	31
3. Uji Autokorelasi	32
4. Uji Heterokedastisitas	33
C. Pengujian Hipotesis	36
1. Perubahan Risiko	36
2. Perilaku Temporal Risiko	38
3. Pengaruh Perubahan Risiko Terhadap Return	40

BAB V PENUTUP

A. Simpulan	44
B. Diskusi.....	44
C. Keterbatasan	47
D. Implikasi	48
Daftar Pustaka	49
Lampiran	53