

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Ruang Lingkup Pembahasan	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB 2 LANDASAN^o TEORI	
2.1 Capital Asset Pricing Model (CAPM).....	8
2.2 Pengujian Terhadap CAPM.....	10



2.3 Beta.....	11
2.4 PER.....	12
2.5 Book to Market.....	16
2.6 Size.....	18
2.7 Pengujian Terhadap model Tiga Faktor.....	19
2.8 Laporan Keuangan dan Pasar Modal.....	26
2.9 Prediksi Risiko Ekuitas.....	29

BAB 3 METODE PENELITIAN

3.1 Penentuan Pemilihan Sampel.....	29
3.2 Pengumpulan Data.....	29
3.3 Pengolahan Data.....	30
3.4 Menghitung Return Harian Perusahaan.....	31
3.5 Menghitung Beta.....	32
3.6 Pengujian Statistik.....	33
3.7 Pengujian Secara Cross Sectional.....	33
3.8 Pengujian Secara Cross Sectional time series Keseluruhan Periode.....	34

BAB 4 ANALISA HASIL PENGUJIAN

4.1 Cross Sectional.....	35
4.2 Cross Sectional Time series Keseluruhan Periode.....	41
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis.....	46



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis pengaruh Beta, Book to Market, Size, PER terhadap Return pada perusahaan-perusahaan LQ45-BEJ

NUGROHO, Teddy, Mamduh M. Hanafi, Dr., MBA

Universitas Gadjah Mada, 2007 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	48
5.2 Keterbatasan	50
5.3 Saran	52

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Statistik Deskriptif	36
Tabel 4.2 Koefisien Korelasi Beta, Book to Market, Size, PER Terhadap Return	37
Tabel 4.3 Model Summary	38
Tabel 4.4 Cefficiens(a).....	41
Tabel 4.5 Statistik Deskriptif.....	42
Tabel 4.6 Koefisien Korelasi Beta, Book to Market, Size, PER Terhadap Return	43
Tabel 4.7 Model Summary.....	44
Tabel 4.8 Cefficiens(a).....	46
Tabel 4.9 Nilai R^2 , F value, Adjusted R^2	47

LAMPIRAN

Lampiran 1: Data Hasil Perhitungan Rata-Rata Return, Beta, Book to Market, Size, PER	55
Lampiran 2: Data Hasil Perhitungan Rata-Rata Return, Beta, Book to Market, Size, PER Per Tahun.....	57
Lampiran 3: Hasil Olah Data SPSS (Corss Secional).....	63
Lampiran 3: Hasil Olah Data SPSS (Corss Secional time Series Keseluruhan Periode)	