

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
ABSTRACT	xii
INTISARI	xiii
 BAB I	
PENDAHULUAN.....	1
1.1. LATAR BELAKANG PENELITIAN.	2
1.2. POKOK PERMASALAHAN	4
1.3. TUJUAN PENELITIAN	4
1.4. MANFAAT PENELITIAN	4
1.5. SISTEMATIKA PENULISAN	5
 BAB II	
TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	6
2.1. TINJAUAN PUSTAKA	6

2.1.1. PENGERTIAN BETA SAHAM	7
2.1.2. UKURAN PERUSAHAAN	10
2.1.3. PENGERTIAN RISIKO	11
2.1.4. <i>RETURN</i> SAHAM	12
2.2. PENELITIAN SEBELUMNYA DAN PENGEMBANGAN –	
HIPOTESIS	12
BAB III	
METODE PENELITIAN	16
3.1. SIFAT PENELITIAN	16
3.2. POPULASI DAN PENENTUAN SAMPEL	16
3.3. PROSES SELEKSI SAMPEL	17
3.4. DEFINISI OPERASIONAL DAN PENGUKURAN VARIABEL	19
3.4.1. VARIABEL BETA SAHAM.....	19
3.4.2. VARIABEL UKURAN PERUSAHAAN	20
3.4.3. VARIABEL TOTAL RISIKO	21
3.4.4. VARIABEL <i>RETURN</i> SAHAM	21
3.5. METODE ANALISIS DATA	21
3.6. UJI ASUMSI KLASIK.....	23
3.6.1. UJI MULTIKOLINEARITAS	24
3.6.2. UJI AUTOKORELASI	24
3.6.3. UJI HETEROSKEDASTISITAS	25
BAB IV	
HASIL PENELITIAN DAN ANALISIS	26



4.1. GAMBARAN UMUM HASIL PENELITIAN	26
4.2. HASIL UJI ASUMSI KLASIK.....	29
4.2.1. UJI MULTIKOLINEARITAS	29
4.2.2. UJI AUTOKORELASI	31
4.2.3. UJI HETEROSKEDASTISITAS.....	32
4.3. ANALISIS HASIL PENGUJIAN HIPOTESIS	32
4.3.1. PENGUJIAN DENGAN MENGGUNAKAN- MODEL REGRESI	32
4.3.2. PENGUJIAN BERDASARKAN KONDISI PASAR	35
BAB V	
KESIMPULAN DAN KETERBATASAN PENELITIAN	37
5.1. KESIMPULAN	37
5.2. KETERBATASAN PENELITIAN DAN SARAN	39
REFERENSI	41

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
3.1. PROSES SELEKSI SAMPEL	18
4.1. PANEL A: JUMLAH OBSERVASI	18
PANEL B: RATA-RATA UKURAN PERUSAHAAN	27
PANEL C: RATA-RATA <i>RETURN</i> BULANAN	27
PANEL D: DEVIASI STANDAR <i>RETURN</i> BULANAN	28
4.2. PANEL A DAN B: UJI MULTIKOLINEARITAS	30
4.3. PANEL A DAN B: UJI AUTOKORELASI	31
4.4. PENYENSORAN DATA	33
4.5. PEMBENTUKAN KUARTIL BETA	35

Gambar

Halaman

1. BETA SAHAM	7
---------------------	---

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Halaman
1. DAFTAR PERUSAHAAN SAMPEL	43
2. UJI HETEROSKEDASTISITAS	45
3. MODEL REGRESI PENYENSORAN DATA.	48
4. MODEL REGRESI PEMBENTUKAN KUARTIL BETA	58