

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	15
C. Tujuan Penelitian	16
D. Kontribusi Penelitian	17
BAB II KAJIAN PUSTAKA & KERANGKA PEMIKIRAN	18
A. Landasan Pustaka	18
1. Investasi	18
2. Pasar Modal	22
3. Saham	24
4. Indeks Harga Saham Gabungan	26
5. Konsep <i>Risk</i> dan <i>Return</i>	27
6. <i>Return</i> Investasi	28
7. Risiko Investasi	30
8. <i>Capital Assets Pricing Model (CAPM)</i>	30
B. Penelitian Terdahulu	36
C. Kerangka Pemikiran	44
BAB III METODE PENELITIAN	46
A. Waktu dan Tempat Penelitian	46
B. Desain Penelitian	46
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	47
D. Populasi dan Sampel Penelitian	49
1. Populasi penelitian	49
2. Sampel Penelitian	49
E. Teknik Penelitian Data	50
F. Metode Analisis Data	51
1) Analisis Statistik Deskriptif	53
2) Uji Asumsi Regresi Klasik	53
G. Pengujian Hipotesis	55

1) Koefisien determinasi (R^2)	56
2) Uji t	56
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	58
A. Gambaran Umum	58
B. Analisis Statistik Deskriptif	62
C. Uji Asumsi Regresi Klasik	64
A. Uji Normalitas Sisaan (Error)	64
B. Uji Heteroskedastisitas	69
C. Uji Autokorelasi	73
D. Hasil Analisis Regresi Berganda	77
E. Pengujian Hipotesis	81
a. Uji Koefisien Determinasi (R^2)	81
b. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t)	86
F. Pembahasan	91
G. Data <i>Outlier</i>	95
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	97
A. Kesimpulan	97
B. Saran	99
DAFTAR PUSTAKA	101
LAMPIRAN	109

