

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	xii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	xiiiiv
<i>ABSTRACT</i>	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR	xvi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	8
1.4 Sistematika Penulisan.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Pengertian Investasi dan Risiko Investasi	10

2.1.1	Pengertian Investasi	10
2.1.2	Pengertian Risiko Investasi	12
2.2	Beta Saham.....	16
2.2.1	Pengaruh Beta Saham Periode Sebelumnya Terhadap Return Saham	19
2.2.2	Hubungan antara Beta Saham dengan Risiko Keuangan... dan Risiko Operasional	20
2.3	Konsep Teori Tentang Risiko	21
2.3.1	Teori Kebangkrutan	22
2.3.2	Teori Efisiensi	23
2.4	Pendekatan Beta Saham	24
2.4.1	Faktor - Faktor yang Mempengaruhi Beta Saham	26
2.4.1.1	Financial Risk	27
2.4.1.2	Operating Risk	29
2.5	Penelitian Terdahulu	33
2.6	Kerangka Pemikiran Teoritis	40
2.7	Hipotesis.....	41
BAB I	METODE PENELITIAN.....	43
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	43
3.1.1	Variabel Terikat (Variabel Dependen).....	43

3.1.2 Variabel Bebas (Variabel Independen)	45
3.2 Populasi dan Sampel	50
3.3 Jenis dan Sumber Data	52
3.4 Metode Pengumpulan Data	52
3.5 Metode Analisis Data	53
3.5.1 Metode Analisis	53
3.5.2 Uji Hipotesis	54
3.5.2.1 Uji Statistik F	54
3.5.2.2 Koefisien Determinasi	54
3.5.2.3 Uji Statistik t	55
3.5.3 Uji Asumsi Klasik	55
3.5.3.1 Uji Normalitas	55
3.5.3.2 Uji Autokorelasi	56
3.5.3.3 Uji Multikolinearitas	56
3.5.2.1 Uji Heteroskedastisitas	57
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	58
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	58
4.1.1 Beta Saham	58
4.1.2 Asset Growth	60

4.1.3 Total Asset Turnover	61
4.1.4 Firm Size	62
4.1.5 Financial Leverage	63
4.1.6 Operating Leverage	64
4.2 Analisis Data	66
4.2.1 Pengujian Asumsi Klasik	67
4.2.1.1 Uji Normalitas	67
4.2.1.2 Uji Heteroskedastisitas	70
4.2.1.3 Uji Multikolinearitas	72
4.2.1.4 Uji Autokorelasi	74
4.2.2 Goodness of Fit Model Regresi	75
4.2.2.1 Koefisien Determinasi	75
4.2.2.2 Uji F	76
4.2.3 Uji Hipotesis	77
4.2.3.1 Pengujian Hipotesis Pertama	79
4.2.3.2 Pengujian Hipotesis Kedua	80
4.2.3.3 Pengujian Hipotesis Ketiga	81
4.2.3.4 Pengujian Hipotesis Keempat	81
4.2.3.5 Pengujian Hipotesis Kelima	82

4.3 Interpretasi Hasil	83
BAB V PENUTUP	84
5.1 Kesimpulan	84
5.2 Keterbatasan.....	86
5.3 Saran.....	87
5.3.1 Bagi Investor	87
5.3.2 Bagi Agenda Penelitian Mendatang.....	87
DAFTAR PUSTAKA	91
LAMPIRAN – LAMPIRAN	94

