

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Sampul Depan Skripsi	i
Halaman Judul Skripsi	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Pengesahan Skripsi	iv
Halaman Pengesahan Ujian Skripsi	v
Halaman Motto	vi
Halaman Persembahan	vii
Abstraksi	viii
Kata Pengantar	ix
Ucapan Terima Kasih	xii
Daftar Isi	xiv
Daftar Tabel	xvii
Daftar Gambar	xviii
Daftar Lampiran	xix
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Batasan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	7

BAB II KAJIAN PUSTAKA

2.1 Penelitian Terdahulu	8
2.2 Landasan Teori	10
2.2.1 Konsep Resiko Saham	10
2.2.2 Mengukur Beta	17
2.2.3 Tingkat Keuntungan Saham	22
2.2.4 Mengukur Tingkat Keuntungan	23
2.2.5 Indeks LQ 45	25
2.2.6 <i>Capita Asset Pricing Model</i> (CAPM)	26
2.2.7 Hubungan Resiko dan Keuntungan Dalam Lingkup CAPM	29
2.3 Hipotesis Penelitian	31

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Gambaran Umum	32
3.1.1 Sejarah Serta Perkembangan Pasar Modal Indonesia	32
3.1.2 Organisasi Bursa Efek	38
3.1.3 Bentuk – bentuk Pasar Dalam Bursa Efek Jakarta	39
3.1.4 Proses Penawaran Umum serta Pencatatan Efek di BEJ	40
3.2 Variabel – variable Penelitian	42
3.3 Definisi Operasional Variabel	42
3.4 Data dan Teknik Pengumpulan Data	43
3.5 Populasi dan Sampel	44
3.6 Teknik Analisis	45

BAB IV ANALISIS DATA

4.1 Variabel Penelitian	49
4.1.1 Tingkat Keuntungan Saham Individual (R_i)	50
4.1.2 Tingkat Keuntungan Pasar (R_m)	51

4.1.3	Perhitungan Risiko Sistematis.....	52
4.1.4	Pengujian Korelasi Antara Tingkat Keuntungan Individu Dengan Resiko.....	56
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Kesimpulan.....	61
5.2	Saran.....	62
 DAFTAR PUSTAKA		 64



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 3.1 Kinerja Sebelum Dan Sesudah JATS.....	36
Tabel 3.2 Daftar Perusahaan	44
Tabel 4.1 Tingkat Keuntungan Saham Individual (R_i)	50
Tabel 4.2 Beta Saham.....	53
Tabel 4.3 Daftar Saham Dengan $\beta > 1$	56
Tabel 4.4 Daftar Saham Dengan $\beta < 1$	56
Tabel 4.5 Hasil Korelasi Beta Keseluruhan dengan R_i	58
Tabel 4.6 Hasil Korelasi $\beta > 1$ Dengan R_i	59
Tabel 4.7 Hasil Korelasi $\beta < 1$ Dengan R_i	60



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Risiko Portofolio	12
Gambar 2.2 Beta Suatu Saham.....	19
Gambar 2.3 Security Market Line.....	31



DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1. Tingkat Keuntungan Individu (R_i).....	65
Lampiran 2 . Tingkat Keuntungan Pasar (R_m).....	151
Lampiran 3 . Hasil Regresi Antara R_i Dengan R_m Masing-masing Perusahaan	155
Lampiran 4 . Table R_f	167

