

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN JUDUL BAHASA INGGRIS	ii
ABSTRAK DALAM BAHASA INDONESIA	iii
ABSTRAK DALAM BAHASA INGGRIS	iv
LEMBAR PENGESAHAN SHP	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	10
C. Pembatasan Masalah.....	10
D. Perumusan Masalah.....	11
E. Kegunaan Penelitian.....	12
BAB II KAJIAN TEORITIK	
A. Deskripsi Konseptual.....	13
1. Risiko Investasi.....	13
1.1 Risiko Sistematis.....	19
1.2 Indikator Risiko Sistematis.....	23
2. <i>Leverage</i>	28
3. Kebijakan Dividen.....	33
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	43
C. Kerangka Teoritik.....	45
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	49
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Penelitian.....	50
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	50
C. Metode Penelitian.....	50
D. Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel.....	51
E. Teknik Pengumpulan Data.....	52
F. Konstelasi Hubungan antar Variabel.....	56
G. Teknik Analisis Data.....	57

BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
	A. Deskripsi Data.....	62
	B. Teknik Analisa Data.....	70
	C. Pembahasan Hasil Penelitian.....	79
	D. Keterbatasan Penelitian.....	86
BAB V	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
	A. Kesimpulan.....	88
	B. Implikasi.....	89
	C. Saran.....	90
	DAFTAR PUSTAKA.....	93
	LAMPIRAN.....	97

DAFTAR TABEL

Tabel IV.1 Statistik Deskriptif.....	62
Tabel IV.2 Distribusi Frekuensi Beta (Risiko Sistemik).....	64
Tabel IV.3 Distribusi Frekuensi X1 (<i>Leverage</i>)	66
Tabel IV.4 Distribusi Frekuensi X2 (Kebijakan Dividen)	69
Tabel IV.5 Uji Normalitas.....	71
Tabel IV.6 Uji Multikolinearitas.....	72
Tabel IV.7 Uji Autokorelasi.....	73
Tabel IV.8 Uji Heteroskedastisitas.....	74
Tabel IV.9 Uji Koefisien Korelasi Ganda.....	75
Tabel IV.10 Uji F.....	76
Tabel IV.11 Uji t.....	78
Tabel IV.12 Uji Koefisien Determinasi.....	78

DAFTAR GAMBAR

Gambar II.1 Hubungan positif antara <i>return</i> ekspektasian dengan risiko.....	15
Gambar II.2 Bagan Risiko Investasi.....	17
Gambar II.3 Garis Karakteristik pada beta yang berbeda-beda.....	24
Gambar IV.1 Grafik Histogram Variabel Y (Risiko Sistemik)	65
Gambar IV.2 Grafik Histogram Variabel X1 (<i>Leverage</i>)	67
Gambar IV.3 Grafik Histogram Variabel X ₂ (Kebijakan Dividen).....	70

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Surat Izin Penelitian	97
Lampiran 2 : Surat Balasan Penelitian.....	98
Lampiran 3 : Data untuk Perhitungan <i>Leverage</i>	99
Lampiran 4 : Data untuk Perhitungan <i>Dividend Payout Ratio</i>	100
Lampiran 5 : Tanggal <i>Ex-Dividend Date</i> untuk menentukan waktu pengambilan harga saham	101
Lampiran 6 : Data Perhitungan Beta Saham (β) dengan Model Indeks Tunggal	102
Lampiran 7 : Data IHSG untuk Perhitungan Return Pasar (R_m).....	112
Lampiran 8 : Rekap Data X1, X2, Y.....	115
Lampiran 9 : Perhitungan Jumlah Kelas dan Interval Variabel X1	116
Lampiran 10 : Perhitungan Jumlah Kelas dan Interval Variabel X2	117
Lampiran 11 : Perhitungan Jumlah Kelas dan Interval Variabel Y	118
Lampiran 12 : Statistik Deskriptif.....	119
Lampiran 13 : Uji Normalitas.....	119
Lampiran 14 : Uji Multikolinearitas.....	119
Lampiran 15 : Uji Autokorelasi.....	120
Lampiran 16 : Uji Heteroskedastisitas.....	120
Lampiran 17 : Uji Koefisien Korelasi Ganda.....	120
Lampiran 18 : Uji Koefisien Korelasi Simultan (Uji F)	120
Lampiran 19 : Uji Koefisien Korelasi Parsial (Uji t)	121
Lampiran 20 : Uji Koefisien Determinasi.....	121
Lampiran 21 : Tabel Isaac Michael.....	122
Lampiran 22 : Tabel Durbin Watson.....	123
Lampiran 23 : Contoh Surat Announcement Dividend KSEI.....	124
Lampiran 24 : Contoh Laporan Keuangan Perusahaan.....	127
Lampiran 25 : Biografi Penulis.....	133