

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PERSETUJUAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
LEMBAR PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I. PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah	8
C. Pembatasan Masalah	8
D. Perumusan Masalah	9
E. Kegunaan Penelitian	9
BAB II. KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA BERFIKIR DAN PERUMUSAN HIPOTESIS	
A. Deskripsi Teoritis	
1. Konsep Harga Saham	

a.	Pengertian Saham.....	10
b.	Jenis-jenis Saham.....	12
c.	Karakteristik Saham Biasa dan Preferen	12
d.	Pengertian Harga Saham	13
e.	Penilaian Saham Biasa	15
f.	<i>Return</i> (pengembalian) Saham	18
g.	Indeks Harga Saham	20
h.	Pengukuran <i>Return</i> Bebas Risiko (<i>R_f</i>)	21
2.	Konsep Risiko Saham	
a.	Pengertian Risiko	23
b.	Risiko Sistematis, Risiko Tidak Sistematis, dan Risiko Total.....	26
c.	Preferensi Risiko	27
d.	Jenis-jenis Risiko	29
e.	Pengukuran Risiko Sistematis Dengan Pendekatan <i>Capital Asset Pricing Model</i>	29
B.	Kerangka Berpikir.....	36
C.	Perumusan Hipotesis.....	38

BAB III. METODOLOGI PENELITIAN

A.	Tujuan Penelitian	39
B.	Waktu dan Tempat Penelitian	39
C.	Metode Penelitian	39
D.	Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel	

1. Populasi.....	40
2. Teknik Pengambilan Sampel.....	40
E. Teknik Pengambilan Data / Instrumen Penelitian	
1. Variabel Harga Saham	
a. Definisi Konseptual.....	41
b. Definisi Operasional.....	42
2. Variabel Risiko Sistematis	
a. Definisi Konseptual.....	42
b. Definisi Operasional.....	42
F. Konstelasi Hubungan Antar Variabel/ Desain Penelitian	43
G. Teknik Analisis Data	
1. Uji Persyaratan Data	
a. Uji Normalitas	43
b. Uji Linearitas.....	45
2. Uji Hipotesis	
a. Uji Koefisien Korelasi.....	48
b. Uji Keberartian Koefisien Korelasi	49
c. Uji Koefisien Determinasi.....	50

BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Deskripsi Data	
1. Harga Saham.....	51
2. Risiko Sistematis	54

B. Analisis Data	
1. Persamaan Garis Regresi.....	56
2. Uji Pesyaratan Analisis	
a. Uji Normalitas	57
b. Uji Linearitas dan Keberartian Regresi	58
3. Pengujian Hipotesis Penelitian	
a. Koefisien Korelasi	59
b. Keberartian Koefisien Korelasi (Uji-t)	59
c. Koefisien Determinasi	60
C. Diskusi Hasil Penelitian	60
D. Keterbatasan Penelitian	62
BAB V. KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN	
A. Kesimpulan	63
B. Implikasi	64
C. Saran	66
DAFTAR PUSTAKA	67
LAMPIRAN.....	71

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
III.1	Tabel Kerja Analisis Varians Regresi Linier.....	48
IV.1	Distribusi Data Variabel Harga Saham (Y).....	52
IV. 2	Distribusi Frekuensi Variabel Harga Saham (Y).....	52
IV. 3	Distribusi Data Variabel Risiko Sistemik (X).....	55
IV. 4	Distribusi Frekuensi Variabe Risiko Sistemik (X).....	55
IV. 5	Anava Untuk Keberartian dan Linearitas Regresi.....	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
II.1	<i>Systematic Risk, Unsystematic Risk and Total Risk</i>	27
II.2	<i>Indifference Curve</i>	28
III.1	Arah Hubungan Variabel X dan Variabel Y.....	43
IV. 1	Grafik Histogram Variabel Harga Saham (Y).....	53
IV.2	Grafik Histogram Variabel Risiko Sistemik (X).....	56
IV. 3	Persamaan Garis Regresi $\hat{Y} = 6321,21 - 1940,88x$	57

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran		Halaman
1	Surat Permohonan Ijin Penelitian.....	72
2	Surat Keterangan Pelaksanaan Penelitian	73
3	Daftar Saham Indeks LQ 45 Periode Februari-Juli 2008.....	74
4	Daftar Saham Indeks LQ 45 Periode Agustus 08-Januari 09.....	76
5	Daftar Nama Perusahaan Yang Menjadi Sampel.....	78
6	Daftar Suku Bunga Bank Indonesia	79
7	Daftar Indeks LQ 45.....	81
8	Data Harga Saham Perusahaan Indeks LQ 45	84
9	Daftar Harga Saham.....	87
10	Perhitungan <i>Return</i> Saham (R_i)	88
11	Daftar Perhitungan Indeks LQ 45 dan SBI	89
12	Perhitungan Rata-rata Indeks Liquid 45.....	90
13	Perhitungan Beta (Variabel X).....	91
14	Data Variabel X dan Variabel Y	93
15	Data Urut Variabel X dan Y.....	94
16	Perhitungan Distribusi Frekuensi Variabel X	95
17	Grafik Histogram Variabel X.....	96
18	Perhitungan Distribusi Frekuensi Variabel Y	97
19	Grafik Histogram Variabel Y.....	98

20	Perhitungan Rata-Rata, Varians, dan Simpangan Baku Variabel X dan Y	99
21	Perhitungan Persamaan Regresi	101
22	Perhitungan Rata-Rata, Varians, dan Simpangan Baku Persamaan Regresi.....	103
23	Grafik Hubungan Variabel X dan Y	104
24	Perhitungan Normalitas Galat Taksiran	105
25	Tabel Perhitungan Uji Linearitas Regresi	107
26	Perhitungan Uji Linieritas dan Keberartian Regresi	108
27	Perhitungan Koefisien Korelasi <i>Product Moment</i>	109
28	Perhitungan Uji Signifikansi Koefisien Korelasi (Uji-t).....	110
29	Perhitungan Koefisien Determinasi	111
30	Tabel Nilai Z Kurva Normal	112
31	Tabel Nilai r Product Moment	113
32	Tabel Nilai Distribusi t.....	114
33	Tabel Nilai Distribusi F	115
34	Tabel Lilliefors.....	117