

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
2.1 Kajian Pustaka	6
2.1.1 Investasi	6
2.1.2 Portofolio.....	6
2.1.3 Return.....	9
2.1.4 Risiko	12
2.1.5 CAPM	15
2.1.6 APT	17
2.1.7 Inflasi	20
2.1.8 Kurs	22
2.2 Review Penelitian Terdahulu	23
2.3 Kerangka Pemikiran	28
2.4 Hipotesis	29
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	31
3.2 Metode Penelitian	31
3.3 Model Penelitian	31
3.4 Definisi dan Operasionalisasi Variabel Penelitian	32
3.4.1 Return	32
3.4.2 Beta	33
3.4.3 Inflasi	33
3.4.4 Kurs	33
3.5 Metode Pengumpulan Data	34
3.6 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	34

3.7 Metode Analisis	35
3.7.1 Analisis Regresi Linier Berganda	35
3.7.2 Uji Asumsi Klasik	36
3.7.3 Pemilihan Model Estimasi.....	38
3.7.4 Uji Hipotesis	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1 Analisis Deskriptif	42
4.2 Uji Asumsi Klasik	44
4.2.1 Uji Normalitas	44
4.2.2 Uji Multikolinearitas	45
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas	46
4.2.4 Uji Autokorelasi	46
4.3 Pembahasan	47
4.3.1 Uji Chow	47
4.3.2 Hasil Uji Regresi	48
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	54
5.2 Saran	55
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
RIWAYAT HIDUP	

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	26
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif	39
Tabel 4.2 Hasil Uji Multikolinearitas	42
Tabel 4.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas	43
Tabel 4.4 Hasil Uji Autokorelasi	44
Tabel 4.5 Hasil Uji Chow	45
Tabel 4.6 Hasil Regresi	46

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Security Market Line	13
Gambar 2.2 Kerangka Pemikiran	29
Gambar 4.1 Hasil Uji Normalitas	41

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Emiten yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 pada 2009–2012
Lampiran 2	Statistik Deskriptif
Lampiran 3	Uji Normalitas
Lampiran 4	Uji Multikolinearitas
Lampiran 5	Uji Heteroskedastisitas
Lampiran 6	Uji Chow
Lampiran 7	Hasil Regresi