

## DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Motto	iii
Halaman Persembahan	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vii
Bab I Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Hipotesa	6
1.5. Tujuan Penelitian	7
1.6 Manfaat Penelitian	7
1.7 Sistem Pembahasan	8
Bab II Landasan Teori	9
2.1 Teori Investasi	9
2.2 Return dan Risiko	13
2.3 Beta Sebagai Pengukur Risiko Sistematis	16
2.4 Model Indeks Tunggal	19
2.5 Penelitian Terdahulu	24

Bab III Metode Penelitian	27
3.1 Populasi dan Sampel	27
3.2 Jenis dan Sumber Data Penelitian	28
3.3 Analisis Data	28
3.3.1 Perhitungan tingkat Keuntungan Saham Individua	28
3.3.2 Perhitungan Keuntungan Pasar	29
3.3.3 Perhitungan Nilai Beta	29
3.4 Pengujian Hipotesa	30
3.5 Volume dan Jumlah Emiten Tiap Tahun	31
Bab IV Analisa Data	33
4.1 Pengumpulan Data	33
4.2 Tingkat Keuntungan Saham	33
4.3 tingkat Keuntungan Portofolio Pasar	34
4.4 Peritungan Tingkat Risiko Sistematis Saham Perusahaan	35
4.5 Pengujian Hipotesa	38
Bab V Kesimpulan dan Saran	42
5.1 Kesimpulan	42
5.2 Saran	43
Daftar Pustaka	
Lampiran	