

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
RIWAYAT HIDUP	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
MOTTO	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRAC.....	ix
PRAKATA	x
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR GAMBAR	xviii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Ruang Lingkup Penelitian.....	8
1.3 Rumusan Masalah	8
1.4 Tujuan Masalah.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	9
1.6 Sistematika Penelitian	9

BAB II LANDASAN TEORI

2.1	Market Microstructure Theory	11
2.2	Return Saham	12
2.2.1	Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	15
2.2.2	Risiko Premium.....	15
2.3	Beta.....	16
2.4	Hubungan Return Saham dan Beta	18
2.4.1	Pendekatan Unconditional.....	19
2.4.2	Pendekatan Conditional.....	20
2.5	Penelitian Terdahulu.....	21
2.6	Kerangka Pemikiran.....	24
2.7	Bangunan Hipotesis.....	26

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Sumber Data.....	28
3.2	Metode Pengumpulan Data	28
3.3	Polulasi dan Sampel	28
3.3.1	Populasi	28
3.3.2	Sampel.....	29
3.4	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	29
3.4.1	Variabel Penelitian	29
3.4.2	Definisi Operasional Variabel	30
3.4.2.1	Return Saham	30
3.4.2.2	Beta Unconditional.....	31
3.4.2.3	Beta Conditional.....	32

3.5	Metode Analisis Data	33
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	33
3.5.2	Uji Asumsi Klasik	33
3.5.2.1	Uji Normalitas	33
3.5.2.2	Uji Autokorelasi	34
3.5.2.3	Uji Heterokedastisitas.....	35
3.5.3	Pengujian Hipotesis	36
3.5.3.1	Analisis Linier Sederhana.....	36
3.5.3.2	Uji Koefesien Determinasi (R^2).....	37
3.5.3.3	Uji F.....	37
3.5.3.4	Uji T.....	37

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Deskripsi Data	38
4.1.1	Deskripsi Objek Penelitian Data.....	38
4.1.2	Deskripsi Sampel Penelitian.....	39
4.2	Hasil Analisis Data.....	39
4.2.1	Analisis Deskriptif.....	39
4.2.2	Uji Asumsi Klasik	41
4.2.2.1	Uji Normalitas	41
4.2.2.2	Uji Autokorelasi	42
4.2.2.3	Uji Heterokedastisitas.....	43

4.2.3	Analisis Regresi Linier Sederhana	44
4.2.3.1	Uji Koefesien Determinasi (R^2)	45
4.2.3.1.1	Koefesien Determinasi (R^2) Pendekatan Unconditional.....	46
4.2.3.1.2	Koefesien Determinasi (R^2) Pendekatan Conditional.....	47
4.2.3.2	Uji Kelayakan Model (Uji F)	47
4.2.3.2.1	Uji Kelayakan Model (Uji F) Pendekatan Unconditional	48
4.2.3.2.2	Uji Kelayakan Model (Uji F) Pendekatan Conditional	48
4.2.3.3	Uji Hipotesis (Uji T)	49
4.2.3.3.1	Uji Signifikan Parameter Individual (Uji T) Pendekatan Unconditional.....	49
4.2.3.3.2	Uji Signifikan Parameter Individual (Uji T) Pendekatan Conditional.....	50
4.3	Pembahasan	51
4.3.1	Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham Pada Pendekatan Unconditional	51
4.3.2	Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham Pada Pendekatan Conditional	52

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1	Simpulan.....	53
5.2	Saran	53

5.3	Keterbatasan Penelitian.....	54
-----	------------------------------	----

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Isi	Halaman
Tabel 1.1 Harga, Return Ssham dan Beta Saham 11 Perusahaan Yang Terdaftar di LQ45 Pada Tahun 2017-2019	5
Tabel 2.1 Hasil Penelitian Terdahulu	21
Tabel 4.1 Prosedur dan Hasil Pemilihan Sampel	39
Tabel 4.2 Statistik Deskriptive Variabel-Variabel Penelitian.....	41
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Data	42
Tabel 4.4 Hasil Uji Autokorelasi	43
Tabel 4.5 Hasil Uji Hterokedastisitas	44
Tabel 4.6 Hasil Regresi Linier Sederhana	45
Tabel 4.7 Koefesien Determinasi (R2) Pendekatan Unconditional	47
Tabel 4.8 Koefesien Determinasi (R2) Pendekatan Conditional	48
Tabel 4.9 Uji F Pendekatan Unconditinal.....	49
Tabel 4.10 Uji F Pendekatan Conditional.....	49
Tabel 4.11 Uji T Pendekatan Unconditional	50
Tabel 4.12 Uji T Pendekatan Conditional	51

DAFTAR GAMBAR

Isi	Halaman
Gambar 2.1 Hasil Penelitian Terdahulu.....	25