

DAFTAR ISI

LEMBARAN PENGESAHAN	i
LEMBARAN PERNYATAAN	ii
ABSTRAK	iii
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	10
1.3 Batasan Masalah.....	10
1.4 Perumusan Masalah	10
1.5 Maksud dan Tujuan Penelitian.....	11
1.5.1 Maksud Penelitian	11
1.5.2 Tujuan Penelitian.....	11
1.6 Kegunaan Penelitian	11
1.7 Lokasi dan Waktu Penelitian	13
BAB II DAFTAR PUSTAKA	
2.1 Teori dan Konsep.....	14
2.1.1 Pengertian Manajemen Keuangan	14
2.1.2 Pasar Modal	16
2.1.2.1 Pengertian Pasar Modal.....	16
2.1.2.2 Jenis-Jenis Pasar Modal	17
2.1.2.3 Fungsi Pasar Modal.....	18
2.1.3 Investasi	19

2.1.3.1	Pengertian Investasi	19
2.1.3.2	Tujuan Investasi	19
2.1.3.3	Jenis-Jenis Investasi	21
2.1.4	Return	21
2.1.4.1	Sumber-Sumber Return.....	23
2.1.5	Risiko.....	24
2.1.5.1	Pengertian Risiko	24
2.1.5.2	Macam-Macam Risiko	26
2.1.5.3	Tipe-Tipe Risiko	27
2.1.6	Saham LQ45	28
2.2	Kerangka Pemikiran dan Hipotesis.....	30
2.2.1	Landasan Teori	30
2.2.2	Kajian Empiris.....	31
2.2.3	Kerangka Pemikiran	33
2.2.4	Hipotesis	34

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Desain Penelitian	36
3.2	Operasionalisasi Variabel	37
3.3	Populasi dan Sampel Penelitian	39
3.3.1	Pengertian Populasi	39
3.3.2	Pengertian Sampel	52
3.4	Teknik Pengumpulan Data dan Instrumen Penelitian.....	63
3.4.1	Teknik Pengumpulan Data	63
3.4.2	Instrumen Penelitian	64
3.5	Teknik Analisis Data.....	64
3.5.1	Rancangan Analisis dan Uji Hipotesis	65

3.5.2 Uji Asumsi Dasar.....	66
3.5.2.1 Uji Normalitas.....	66
3.5.2.2 Uji Homogenitas	68
3.5.2.3 Uji Beda	69
3.5.2.4 Uji PCA (Principal Componen Analysis. 69	
3.5.3 Uji Hipotesis	70
BAB IV METODE PENELITIAN	
4.1 Deskriptif	72
4.2 Statistik Deskriptif	73
4.2.1 Hasil Analisis Rata-Rata retun dan risiko saham LQ45 dan Non LQ45.....	73
4.3 Uji Asumsi Dasar	89
4.3.1 Hasil Uji Normalitas.....	89
4.3.2 Hasil Uji Homogenitas	91
4.4 Hasil Uji Beda (<i>Independent Sample t-test</i>).....	92
4.5 Hasil Uji PCA (<i>Principal Component Analysis</i>).....	93
4.6 Hasil Uji Hipotesis	97
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	99
5.2 Luaran Tambahan PCA	100
6.1 Saran	101
DAFTAR PUSTAKA.....	102
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

1. Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu
2. Tabel 3.1 Desain Penelitian
3. Tabel 3.2 Operasionalisasi Variabel
4. Tabel Konsisten LQ45 Periode 2013-2017
5. Tabel Non Konsisten LQ45 Periode 2013-2017
6. Tabel 4.1 Rata-Rata Return dan Risiko Saham LQ45 yang Konsisten masuk dalam daftar BEI Periode 2013-2017
7. Tabel 4.2 Rata-Rata Return dan Risiko Saham Non LQ45 yang tidak konsisten tidak pernah masuk dalam daftar BEI Periode 2013-2017
8. Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Return dan Risiko Saham LQ45 dan Non LQ45
9. Tabel 4.4 Hasil Uji Homogeneity Return Saham LQ45 dan Non LQ45
10. 4.5 Hasil Uji Beda (*Independen sample T-test*)
11. Tabel 4.6 Hasil Uji Principal component analysis dari return saham LQ45 dan Non LQ45
12. Tabel 4.6 Hasil Uji Principal component analysis dari risiko saham LQ45 dan Non LQ45

DAFTAR GAMBAR

1. Gambar Grafik Pergerakan Return Periode 2013-2017
2. Gambar Grafik Pergerakan Risiko Periode 2013-2017
3. Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran
4. Gambar 3.2 Daerah Penolakan dan Penerima Ho

DAFTAR LAMPIRAN

1. 18 Saham LQ45 yang konsisten masuk dalam daftara BEI 2013-2017
2. 266 Saham Non LQ45 yang konsisten tidak pernah masuk dalam daftara BEI Periode 2013-2017
3. Hasil Uji PCA 18 perusahaan saham LQ45 dan saham Non LQ45
4. Hasil Uji PCA 261 saham LQ45 dan saham Non LQ45
5. Hasil Uji NORMALITAS
6. Hasil Uji HOMOGENITAS
7. Hasil Uji Beda (*Independent Sample t-test*)