

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN.....	i
KATA PENGANTAR	ii
ABSTRAK.....	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Industri.....	1
1.2 Latar Belakang.....	2
1.3 Rumusan Masalah	8
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	9
1.5.1 Manfaat Dalam Ilmu Pengetahuan.....	9
1.5.2 Manfaat Operasional Bagi Investor	9
1.6 Sistematika Penulisan.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Pasar Modal.....	11
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	11
2.1.2 Jenis-Jenis Pasar Modal	11
2.1.3 Instrumen Pasar Modal	12
2.2 Investasi.....	14
2.2.1 Pengertian Investasi	14
2.2.2 Jenis-Jenis Investasi	15
2.3 Tingkat Risiko dan Tingkat Pengembalian (<i>Risk and Return</i>).....	16
2.3.1 Tingkat Risiko (<i>Risk</i>).....	16
2.3.2 Tingkat Pengembalian (<i>Return</i>).....	19
2.4 <i>Capital Asset Pricing Model</i>	20
2.5 <i>Arbitrage Pricing Theory</i>	24

2.6	<i>Model Autoregressive Integrated Moving Average</i>	28
2.6.1	Pengertian Autoregressive Integrated Moving Average	28
2.6.2	Tahapan-tahapan Model Autoregressive Integrated Moving Average ..	29
2.7	Penelitian Terdahulu	32
2.8	Kerangka Pemikiran	35
2.9	Perumusan Hipotesis	38
BAB III METODE PENELITIAN.....		39
3.1	Jenis Penelitian	39
3.2	Operasional Variabel Penelitian	39
3.3	Jenis dan Sumber Data	40
3.4	Populasi dan Sampel.....	41
3.5	Metode Analisis.....	42
3.6	Rancangan Pengujian Hipotesis	45
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		48
4.1	<i>Capital Asset Pricing Model</i>	48
4.2	<i>Arbitrage Pricing Theory</i>	52
4.3	Uji Asumsi Klasik	70
4.4	Perbandingan Keakuratan <i>Capital Asset Pricing Model</i> dan <i>Arbitrage Pricing Theory</i>	73
4.5	Hasil Uji Hipotesis	74
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		82
5.1	Kesimpulan.....	82
5.2	Saran	82
DAFTAR PUSTAKA		84
LAMPIRAN.....		86