

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	i
DAFTAR TABEL	ii
DAFTAR GAMBAR	iii
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan masalah	6
1.3 Batasan masalah.....	6
1.4 Tujuan penelitian	7
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Kerangka Pemikiran	8
1.7 Hipotesis penelitian	10
II. TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Tinjauan teori.....	11
2.1.1. Pasar modal	11
2.1.2. Pengertian saham.....	12
2.1.3. Pengertian <i>return</i> saham.....	12
2.1.4. Model tiga faktor fama dan french	14
2.1.5. <i>Arbirage pricing theory</i> (APT)	14
2.1.6. Pengertian <i>market return</i>	15
2.1.7. Pengertian <i>firm size</i>	16
2.1.8. Pengertian <i>book to market ratio</i>	16
2.2. Tinjauan empiris	17
III. METODOLOGI PENELITIAN	20
3.1. Metode penelitian	20
3.2. Objek penelitian.....	20
3.3. Jenis dan sumber data	20
3.4. Metode pengumpulan data.....	21
3.5. Populasi dan sampel	21
3.5.1. Populasi	21
3.5.2. Sampel	21
3.6. Batasan variable.....	22
3.6.1. <i>Return</i> saham	23

3.6.2. <i>Market return</i> (Rmt)	24
3.6.3. <i>Firm size</i>	24
3.6.4. <i>Book to market ratio</i>	25
3.7. Metode analisis data	25
3.8. Uji asumsi klasik	26
3.8.1. Uji normalitas	26
3.8.2. Uji multikolinieritas.....	27
3.8.3. Uji Heteroskedastisitas	28
3.8.4. Uji autokorelasi	28
3.9. Uji hipotesis	29
3.9.1. Uji F-statistik	29
3.9.2. Uji t (Keberartian parsial).....	30
IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	32
4.1. Analisis data	32
4.2. Hasil analisis	32
4.2.1. Statistik deskriptif.....	32
4.2.2. Uji asumsi klasik	33
4.2.2.1. Uji normalitas.....	34
4.2.2.2. Uji Heteroskedastisitas.....	35
4.2.2.3. Uji multikolinieritas	36
4.2.2.4. Uji autokorelasi	36
4.2.3. Uji simultan	38
4.2.4. Uji parsial	38
4.3. Pembahasan	41
V. SIMPULAN DAN SARAN	43
5.1. Simpulan	43
5.2. Saran	44
DAFTAR PUSTAKA	iv
LAMPIRAN	v