

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan Penelitian	10
D. Kontribusi Penelitian	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	12
A. Kajian Pustaka	12
1. Investasi	12
a. Pengertian Investasi	12
b. Tujuan Investasi	12
c. Risiko Investasi	12
d. Jenis Risiko	13
e. Proses Investasi	15
2. Pasar Modal	17
a. Pengertian Pasar Modal	17
b. Manfaat Pasar Modal	18
3. Saham	19
4. Teori Harga Aset Modal	21
a. <i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	21
b. <i>Arbitrage Pricing Theory (APT)</i>	23
c. <i>Fama French Three Factors Models</i>	24
d. <i>Fama French Five Factors Models</i>	25
B. Kajian Penelitian Terdahulu	26
C. Rerangka Pemikiran	32
D. Hipotesis	33

BAB III	METODE PENELITIAN	37
	A. Waktu dan Tempat Penelitian	37
	B. Desain Penelitian.....	37
	C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	38
	1. Definisi Variabel	38
	a. Variabel Terikat.....	38
	b. Variabel Bebas	39
	2. Operasionalisasi Variabel.....	42
	D. Populasi dan Sampel Penelitian	43
	E. Metode Pengumpulan Data	44
	F. Metode Analisis Data.....	44
	1. Statistik Deskriptif	44
	2. Uji Stasioneritas	45
	3. Analisis Regresi Linier Berganda	45
	a. Uji Asumsi Regresi Klasik.....	46
	b. Multikolinearitas	48
	c. Uji Hipotesis	49
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	51
	A. Gambaran Umum Obyek Penelitian	51
	B. Statistik Deskriptif	52
	C. Analisis Regresi Linier Berganda	54
	1. Hasil Uji Regresi Asumsi Klasik.....	57
	a. Uji Normalitas	57
	b. Uji Heteroskedastisitas	58
	c. Uji Autokorelasi	59
	2. Hasil Uji Multikolinearitas.....	59
	3. Hasil Uji Model.....	61
	a. Hasil Uji Simultan F (Uji F).....	61
	b. Hasil Uji Koefisien Determinasi (Adjusted R ²)	61
	c. Hasil Uji Signifikansi Parsial (Uji-t).....	63
	D. Uji Hipotesis	66
	E. Pembahasan.....	67
BAB V	SIMPULAN DAN SARAN	74
	A. Simpulan	74
	B. Saran.....	75
DAFTAR PUSTAKA		77