

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	7
C. Tujuan Dan Kontribusi Penelitian	8
1. Tujuan Penelitian	8
2. Kontribusi Penelitian	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	10
A. Kajian Pustaka.....	10
1. <i>Asset Pricing</i>	10
2. <i>Return</i>	10
3. <i>Capital Assets Pricing Model</i>	12

4. Fama and French Three Factors Model	14
5. Fama and French Five Factors Model	15
6. Penelitian Terdahulu.....	16
B. Rerangka Pemikiran	19
C. Hipotesis.....	19
BAB III METODE PENELITIAN	22
A. Waktu dan Tempat Penelitian	22
B. Desain Penelitian	22
C. Definisi dan Operasional Variabel	22
1. Definisi Variabel.....	23
a. Variabel Terikat (Dependent Variabel)	23
b. Variabel Bebas (Independent Variabel)	23
2. Operasionalisasi Variabel	25
D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	25
E. Teknik Pengumpulan Data	27
F. Metode Analisis.....	28
1. Statistik Deskriptif	28
2. Uji Asumsi Regresi Klasik	28
a) Uji Normalitas.....	29
b) Uji Autokorelasi	29
c) Uji Heteroskedastisitas.....	30
d) Analisis Regresi Linear Berganda.....	30
e) Uji Ketetapan Model	32

1. Uji F	32
2. Koefisien Determinasi	33
f) Uji T	34
g) Uji Multikolineritas	35

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian	36
B. Analisis Deskriptif	39
C. Uji Asumsi Regresi Klasik	42
1. Uji Normalitas	42
2. Uji Autokorelasi	42
3. Uji Heterokedastisitas	43
4. Analisis Regresi Linear Berganda	43
5. Uji Model	46
a. Uji F	46
b. Koefisien Determinasi (R^2)	47
c. Uji T	47
D. Uji Multikolineritas	49
E. Pembahasan	50

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	53
B. Saran	54

DAFTAR PUSTAKA 56