

## DAFTAR ISI

<b>SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI .....</b>	<b>ii</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR .....</b>	<b>v</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang .....	1
B. Rumusan Masalah .....	8
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian .....	9
1. Tujuan Penelitian .....	9
2. Kontribusi Penelitian .....	9
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA KONSEPTUAL DAN HIPOTESIS</b>	
A. Kajian Pustaka .....	11
1. Investasi Saham .....	11
2. Pasar Modal .....	13
3. Imbal Hasil dan Risiko.....	14
4. Faktor-faktor Sebagai Indikator Makroekonomi .....	16
5. <i>Arbitrage Pricing Theory</i> (APT) .....	18
6. Model Penelitian .....	21
7. Perhitungan Variabel yang Digunakan Dalam Model Penelitian .....	22
8. Penelitian Terdahulu .....	25
B. Rerangka Pemikiran .....	29

C. Hipotesis .....	30
<b>BAB 3 METODOLOGI PENELITIAN</b>	
A. Waktu dan Tempat Penelitian .....	31
B. Desain Penelitian .....	31
C. Definisi dan Operasional Variabel .....	32
D. Populasi dan Sampel Penelitian .....	33
E. Teknik Pengumpulan Data .....	35
F. Metode Analisis Data .....	36
<b>BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	
A. Gambaran Umum Sektor Pertambangan Batubara .....	45
B. Hasil Uji Statistik Deskriptif .....	47
C. Hasil Uji Stationer .....	49
D. Hasil Uji Asumsi Klasik Regresi Linier Berganda .....	53
1. Hasil Uji Normalitas .....	55
2. Hasil Uji Autokorelasi .....	56
3. Hasil Uji Heterokedasitas .....	56
E. Hasil Uji Multikolonieritas .....	57
F. Hasil Uji Hipotesis .....	58
1. Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	58
2. Uji Signifikasi Simultan (Uji Statistik F) .....	59
3. Uji Signifikasi Parameter Individual (Uji Statistik t) .....	60
G. Pembahasan Hasil Penelitian .....	65
<b>BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN</b>	
A. Simpulan .....	67
B. Saran .....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>69</b>
<b>Lampiran .....</b>	<b>73</b>