

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Intisari	ix
Abstract	x
Daftar Tabel	xi

BAB 1 PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang	1
1.2. Tujuan Penelitian	6
1.3. Manfaat Penelitian	7
1.4. Perumusan Masalah	7
1.5. Batasan Masalah	8
1.6. Sistematika Pembahasan	9

BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA

2.1. Pasar Modal	10
2.2. Pasar Modal yang Efisien	11
2.3. Pengertian Analisis Faktor Fundamental	13
2.4. Tinjauan Penelitian Terdahulu	19

2.5. Perumusan Hipotesis	21
--------------------------------	----

BAB 3 METODOLOGI PENELITIAN

3.1. Sumber Penelitian	26
3.2. Penentuan Sampel	26
3.3. Periode Pengamatan	27
3.4. Kerangka Pemikiran	27
3.5. Metode Analisis Data	28
3.6. Definisi Operasional	28
3.6.1. <i>Return</i>	28
3.6.2. <i>Size</i>	29
3.6.3. <i>Book to Market Equity</i>	29
3.6.4. <i>Price Earnings Ratio</i>	29
3.6.5. <i>Beta</i>	30
3.7. Uji Asumsi Klasik	30
3.7.1. Uji <i>Normalitas</i>	30
3.7.2. Uji <i>Multikolinearitas</i>	31
3.7.3. Uji <i>Autokorelasi</i>	32
3.7.4. Uji <i>Heteroasedastisitas</i>	33
3.8. Uji Statistik	33

BAB 4 ANALISIS DAN HASIL PENELITIAN

4.1. Sampel Penelitian	36
4.2. Penghitungan <i>Return</i> Sebagai Variabel Dependen	39
4.3. Hasil Pengujian Asumsi Klasik	40



4.3.1. Uji <i>Normalitas</i>	40
4.3.2. Uji <i>Multikolinearitas</i>	41
4.3.3. Uji <i>Autokorelasi</i>	42
4.3.4. Uji <i>Heteroskedastisitas</i>	43
4.4. Uji Statistik	44
4.5. Pengujian Hipotesis	46
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan	52
5.2. Keterbatasan, Saran dan Implikasi	53
DAFTAR PUSTAKA	55
LAMPIRAN	