

DAFTAR ISI

JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
ABSTRACT	xi
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian	7
1.5 Manfaat Penelitian	8
1.6 Lingkup Penelitian	8
1.7 Sistematika Penelitian	9
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Teori Investasi dan <i>Return Saham</i>	11
2.2 <i>Return Saham</i> dan Faktor-faktor yang Berpengaruh	12
2.3 <i>Asset Pricing Model</i>	13
2.4 Market Risk Premium	17
2.5 <i>Firm Size</i>	18
2.6 Book-to-Market Equity Ratio	18
2.7 Profitability Ratio	19
2.8 Investment Ratio	19
2.9 Kajian Penelitian Terdahulu	19
2.10 Perumusan Hipotesis	20

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Data dan Sampel Penelitian	23
3.2 Definisi Operasional	25
3.3 Model Empiris	26
3.4 Uji Normalitas Data	27
3.5 Uji Asumsi Klasik	28
3.6 Uji Hipotesis	30

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Statistik Deskriptif	33
4.2 Uji Regresi Berganda	36
4.3 Uji Normalitas Data	39
4.4 Uji Asumsi Klasik	40
4.5 Uji Hipotesis	44

BABV PENUTUP

5.1 Kesimpulan	48
5.2 Implikasi	51
5.3 Keterbatasan	52
5.4 Saran	52

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN