

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINILITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Manfaat Penelitian.....	11
1.5 Sistematika Penulisan.....	12
BAB II TELAAH PUSTAKA	14
2.1 Definisi	14
2.1.1 Pasar Modal.....	14
2.1.2 Saham.....	15
2.1.3 <i>Ambiguity</i>	16
2.1.4 <i>Market Risk Premium</i>	18
2.1.5 <i>Market to Book</i>	19
2.1.6 <i>Size</i>	20
2.1.7 Momentum	21
2.2 Landasan Teori	22
2.2.1 Teori Ekspektasi Rasioanl (<i>Rational Expectation Theory</i>).....	22
2.2.2 Model 3 Faktor Fama dan French.....	23
2.2.3 Momentum.....	24

2.3	Penelitian Terdahulu.....	25
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis dan Perumusan Hipotesis.....	31
2.4.1	Pengaruh <i>Ambiguity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	31
2.4.2	Pengaruh <i>Market Risk Premium</i> terhadap <i>Return Saham</i>	32
2.4.3	Pengaruh <i>Market to Book</i> terhadap <i>Return Saham</i>	32
2.4.4	Pengaruh <i>Size</i> terhadap <i>Return Saham</i>	33
2.4.5	Pengaruh Momentum terhadap <i>Return Saham</i>	34
2.5	Hipotesis.....	35
BAB III METODE PENELITIAN.....		36
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	36
3.1.1	Variabel Penelitian.....	36
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	38
3.2	Populasi dan Sampel.....	40
3.2.1	Populasi.....	40
3.2.2	Sampel.....	40
3.3	Jenis dan Sumber Data.....	42
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	42
3.5	Metode Analisis.....	43
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	44
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	44
3.5.2.1	Uji Normalitas.....	45
3.5.2.2	Uji Multikolonieritas.....	46
3.5.2.3	Uji Autokorelasi.....	47
3.5.2.4	Uji Heteroskedastisitas.....	47
3.5.3	Uji Hipotesis.....	49
3.5.3.1	Uji Koefisien Determinasi.....	49
3.5.3.2	Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	49
3.5.3.3	Uji Parsial (Uji t).....	51
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		52
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian.....	52
4.2	Analisis Data.....	52
4.2.1	Statistik Deskriptif Objek Penelitian.....	52

4.2.2	Uji Asumsi Klasik.....	53
4.2.2.1	Uji Normalitas	53
4.2.2.2	Uji Multikolonieritas	56
4.2.2.3	Uji Autokorelasi	57
4.2.2.4	Uji Heteroskedastisitas	58
4.2.3	Uji Hipotesis	60
4.2.3.1	Uji Koefisien Determinasi (R^2)	60
4.2.3.2	Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	61
	Tabel 4.7.....	62
	Hasil Uji F.....	62
4.2.3.3	Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t).....	63
	Tabel 4.8.....	63
	Hasil Uji Statistik t.....	63
4.3	Interpretasi Hasil	65
4.3.1	Pengaruh <i>Ambiguity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	65
4.3.2	Pengaruh <i>Market Risk Premium</i> terhadap <i>Return Saham</i>	66
4.3.3	Pengaruh <i>Market to Book</i> terhadap <i>Return Saham</i>	67
4.3.4	Pengaruh <i>Size</i> terhadap <i>Return Saham</i>	68
4.3.5	Pengaruh Momentum terhadap <i>Return Saham</i>	69
BAB V PENUTUP.....		70
5.1	KESIMPULAN	70
5.2	KETERBATASAN	71
5.3	SARAN	72
DAFTAR PUSTAKA		73
LAMPIRAN A.....		77
LAMPIRAN B		79
LAMPIRAN C		84