

DAFTAR ISI

	Halaman
Judul	i
Halaman Persetujuan Skripsi	ii
Halaman Pengesahan Kelulusan Ujian	iii
Pernyataan Orisinalitas	iv
<i>Abstract</i>	v
Abstrak	vi
Moto dan Persembahan	vii
Kata Pengantar	viii
Daftar Isi	xi
Daftar Tabel	xv
Daftar Gambar	xvi
Daftar Lampiran	xvii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	9
1.3 Tujuan Penelitian	13
1.4 Kegunaan Penelitian	13
1.5 Sistematika Penulisan	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Definisi-definisi	16
2.1.1 Saham	16
2.1.2 Pasar Modal	19
2.1.3 <i>Return</i> Saham	20
2.1.4 <i>Distress Risk</i>	22

2.1.5	<i>Size</i>	23
2.1.6	<i>Book to Market</i>	24
2.1.7	<i>Momentum</i>	25
2.2	Landasan Teori	25
2.2.1	Teori <i>Financial Distress</i>	25
2.2.2	Model Teori <i>Three Factor Stock Return</i> Fama dan French	26
2.2.3	Model Teori <i>Momentum</i>	27
2.3	Penelitian Terdahulu	28
2.4	Hubungan Antar Variabel	32
2.4.1	Hubungan <i>disress risk</i> dan <i>return</i> saham	32
2.4.2	Hubungan <i>size</i> dan <i>return</i> saham	33
2.4.3	Hubungan <i>book to market</i> dan <i>return</i> saham	34
2.4.4	Hubungan <i>momentum</i> dan <i>return</i> saham	34
2.5	Kerangka Pemikiran Teoritis	35
2.6	Hipotesis	35

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	36
3.1.1	Variabel Penelitian	36
3.1.2	Definisi Operasional Variabel	36
3.1.2.1	<i>Distress risk</i>	36
3.1.2.2	<i>Size</i>	37
3.1.2.3	<i>Book to market</i>	38
3.1.2.4	<i>Momentum</i>	38
3.1.2.5	<i>Return</i>	38
3.2	Populasi dan Sampel Penelitian	41
3.2.1	Populasi	41
3.2.2	Sampel	41
3.3	Jenis dan Sumber Data	43
3.4	Metode Pengumpulan Data	43

3.5 Metode Analisis Data	44
3.6 Statistik Deskriptif.....	44
3.7 Uji Asumsi Klasik	44
3.7.1 Uji Normalitas	44
3.7.2 Uji Multikolinieritas	46
3.7.3 Uji Autokorelasi	46
3.7.4 Uji Heteroskedastisitas	47
3.8 Analisis Regresi	48
3.9 Uji Hipotesis	49
3.9.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	49
3.9.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	50
3.9.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	50
3.10 Chow Test	50

BAB IV HASIL DAN ANALISIS

4.1 Deskripsi Objek Penelitian	52
4.2 Sektor Industri Dasar	60
4.2.1 Statistik Deskriptif	60
4.2.2 Uji Asumsi Klasik	62
4.2.2.1 Uji Normalitas	63
4.2.2.3 Uji Multikolinearitas	65
4.2.2.3 Uji Autokorelasi	66
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas	67
4.2.3 Pengujian Hipotesis	68
4.2.3.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	68
4.2.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	69
4.2.3.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	70
4.2.4 Pembahasan	72
4.3 Sektor Industri Barang Konsumsi	75
4.3.1 Statistik Deskriptif	75

4.3.2 Uji Asumsi Klasik	77
4.3.2.1 Uji Normalitas	78
4.3.2.3 Uji Multikolinearitas	80
4.3.2.3 Uji Autokorelasi	81
4.3.2.4 Uji Heterokedastisitas	82
4.3.3 Uji Hipotesis	83
4.3.3.1 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	83
4.3.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	84
4.3.3.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	85
4.3.4 Pembahasan	87
4.4 <i>Chow Test</i>	90
BAB V PENUTUP	
5.1 Kesimpulan	93
5.2 Keterbatasan Penelitian	96
5.3 Saran	96
5.3.1 Saran bagi Investor	96
5.3.2 Saran untuk Penelitian Selanjutnya	96
Daftar Pustaka	97
Lampiran-Lampiran	100