

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTO 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	17
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	18
1.1.1 Tujuan Penelitian	18
1.1.2 Kegunaan Penelitian	19
1.4 Sistematika Penulisan	20
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	22
2.1 Landasan Teori.....	22
2.1.1 <i>The Fama and French Three Factor Model</i>	22
2.1.2 Model Teori Momentum	23
2.1.3 Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	24
2.2 Penelitian Terdahulu	27
2.3 Pengaruh Antar Variabel dan Rumusan Hipotesis.....	42
2.3.1 Pengaruh <i>Book to Market Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i>	42
2.3.2 Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap <i>Return Saham</i>	43
2.3.3 Pengaruh <i>Market Value Added (MVA)</i> terhadap <i>Return Saham</i>	44
2.3.4 Pengaruh Momentum terhadap <i>Return Saham</i>	45
2.3.5 Pengaruh <i>Trading Volume</i> perusahaan terhadap <i>Return Saham</i>	46
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis	47

2.5 Hipotesis	48
BAB III.....	49
METODOLOGI PENELITIAN	49
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	49
3.1.1 Variabel Penelitian	49
3.1.2 Definisi Operasional Variabel	50
3.2 Populasi dan Sampel	56
3.2.1 Populasi	56
3.2.2 Sampel	57
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	59
3.3.1 Jenis Data.....	59
3.3.2 Sumber Data	59
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	59
3.5 Metode Analisis Data.....	60
3.5.1 Analisa Statistik Deskriptif.....	60
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	61
3.5.3 Model Analisis Regresi	65
3.5.4 Pengujian Hipotesis	66
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	70
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	70
4.2 Statistik Deskriptif	71
4.3 Uji Asumsi Klasik.....	74
4.3.1 Uji Normalitas	75
4.3.2 Uji Multikolinieritas	76
4.3.3 Uji Autokorelasi	78
4.3.4 Uji Heteroskedastisitas	78
4.4 Analisis Regresi Linier Berganda	81
4.4.1 Pengujian Hipotesis	82
4.4.1.1 Uji Statistik F (Uji Signifikansi Simultan).....	82
4.4.1.2 Uji Statistik t (Uji Signifikansi Parameter Individual).....	83
4.4.1.3 Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	86

4.5 Pembahasan.....	87
4.5.1 Pengaruh <i>book to market equity</i> terhadap <i>return</i> saham.	87
4.5.2 Pengaruh <i>firm size</i> terhadap <i>return</i> saham.	88
4.5.3 Pengaruh <i>market value added</i> (MVA) terhadap <i>return</i> saham.....	89
4.5.4 Pengaruh <i>momentum</i> terhadap <i>return</i> saham.....	90
4.5.5 Pengaruh <i>trading volume</i> terhadap <i>return</i> saham.....	91
BAB V PENUTUP	92
5.1 Kesimpulan	92
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	95
5.3 Saran	95
5.3.1 Bagi Investor	96
5.3.2 Bagi Akademisi	96
DAFTAR PUSTAKA	98