

## DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI .....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iv
<i>ABSTRACT</i> .....	v
ABSTRAK .....	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	vii
KATA PENGANTAR .....	viii
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR GAMBAR.....	xviii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	7
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian .....	8
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	8
1.3.2 Manfaat Penelitian.....	9
1.4 Sistematika Penulisan .....	10
BAB II TELAAH PUSTAKA .....	12

2.1	Definisi-definisi.....	12
2.1.1	Saham .....	12
2.1.2	<i>Return</i> Saham.....	15
2.1.3	<i>Beta</i> Saham.....	17
2.1.4	<i>Aggressive Stock</i> .....	21
2.1.5	<i>Size</i> .....	21
2.1.6	<i>Book to Market Ratio</i> .....	22
2.1.7	<i>Profitability</i> .....	23
2.1.8	<i>Three Factor Model from Fama and French</i> .....	25
2.2	Penelitian Terdahulu.....	26
2.3	Hubungan Antar Variabel dan Rumusan Masalah.....	36
2.3.1	Pengaruh <i>Beta</i> terhadap <i>Return</i> Agresif Stock.....	36
2.3.2	Pengaruh <i>Size</i> terhadap <i>Return</i> Agresif Stock.....	38
2.3.3	Pengaruh <i>MBR</i> terhadap <i>Return</i> Agresif Stock.....	38
2.3.4	Pengaruh <i>Profitability</i> terhadap <i>Return</i> Agresif Stock .....	39
2.4	Kerangka Pemikiran.....	40
2.5	Hipotesis.....	41
BAB III METODE PENELITIAN.....		42
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Variabel .....	42
3.1.1	Variabel Penelitian.....	42
3.1.2	Definisi Operasional.....	43
3.1.2.1	Beta Saham .....	43

3.1.2.2	Size .....	44
3.1.2.3	Book to Market Ratio .....	44
3.1.2.4	Profitability .....	44
3.1.2.5	Return Aggressive Stock .....	45
3.2	Populasi dan Sampel .....	47
3.3	Jenis dan Sumber Data .....	49
3.4	Metode Pengumpulan Data .....	50
3.5	Metode Analisis Data .....	50
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif .....	50
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	51
3.5.2.1	Uji Normalitas .....	51
3.5.2.2	Uji Multikolinearitas .....	52
3.5.2.3	Uji Autokorelasi.....	52
3.5.2.4	Uji Heteroskedastisitas.....	54
3.5.2.5	Uji Hipotesis .....	54
3.5.2.6	Uji Koefisien Determinasi .....	55
3.5.2.7	Uji Statistik F .....	56
3.5.2.8	Uji Statistik t .....	56
3.5.2.9	Regresi Berganda .....	57
BAB IV HASIL DAN ANALISIS .....		58
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian .....	58
4.2	Analisis Statistik Deskriptif .....	59
4.2.1	Statistik Deskriptif .....	59
4.2.2	Uji Asumsi Klasik .....	62

4.2.2.1 Uji Normalitas .....	62
4.2.2.2 Uji Multikolinearitas .....	66
4.2.2.3 Uji Autokorelasi.....	68
4.2.3.4 Uji Heteroskedastisitas.....	69
4.2.3 Pengujian Hipotesis .....	71
4.2.3.1 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	71
4.2.3.2 Uji Statistik F.....	72
4.2.3.3 Uji Statistik t .....	73
4.3 Pembahasan Hasil Uji Hipotesis .....	76
<b>BAB V PENUTUP .....</b>	<b>81</b>
5.1 Kesimpulan .....	81
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	82
5.3 Saran Penelitian... ..	83
5.3.1 Saran bagi Para Investor... ..	83
5.3.2 Saran bagi Para Akademisi... ..	84
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>85</b>
<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN .....</b>	<b>89</b>