

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
MOTTO	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	10
1.5 Sistematika Penulisan	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Definisi	12
2.1.1 Pengertian <i>Return Saham</i>	12
2.1.2 Risiko dan <i>Return Saham</i>	12
2.2 Landasan Teori.....	13
2.2.1 <i>Arbitrage Pricing Theory</i>	13
2.2.2 <i>Bussines Life Cycle Theory</i>	14
2.3 Penelitian Terdahulu	15
2.4 Faktor-faktor yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	25
2.4.1 Kurs	25
2.4.2 Suku Bunga	25
2.4.3 Harga Minyak	26
2.4.4 Indeks Saham Utama.....	26
2.4.5 Harga Emas	27
2.5 Kerangka Pemikiran Teoritis	27
2.5.1 Pengaruh Kurs Terhadap <i>Return Saham</i>	27
2.5.2 Pengaruh Suku Bunga Terhadap <i>Return Saham</i> ..	28
2.5.3 Pengaruh Harga Minyak Terhadap <i>Return Saham</i>	29
2.5.4 Pengaruh Indeks Saham Terhadap <i>Return Saham</i>	30
2.5.5 Pengaruh Harga Emas Terhadap <i>Return Saham</i> ..	31
2.5.6 Kerangka Pemikiran Teoritis	32
2.6 Hipotesis Penelitian	32

BAB III	METODE PENELITIAN	33
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	33
3.1.1	Variabel penelitian	33
3.1.2	Definisi Operasional Variabel	33
3.2	Populasi	38
3.3	Sampel	38
3.4	Jenis dan Sumber Data	39
3.5	Metode Pengumpulan Data	39
3.5.1	Metode Kepustakaan	40
3.5.2	Metode Dokumentasi	40
3.6	Metode Analisis Data	40
3.6.1	Uji Asumsi Klasik	41
3.6.2	Analisis Regresi Berganda	46
3.6.3	Pengujian Hipotesis	47
BAB IV	ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	50
4.1	Gambaran Obyek Penelitian	50
4.2	Pengujian Asumsi Klasik	51
4.2.1	Pengujian Multikolinearitas	51
4.2.2	Pengujian Heteroskedastisitas	54
4.2.3	Pengujian Autokorelasi	56
4.2.4	Pengujian Normalitas	59
4.3	Analisis Regresi Berganda	63
4.4	Pengujian Hipotesis.....	66
4.4.1	Uji t	67
4.4.2	Uji F	69
4.4.3	Uji R^2	70
4.5	Interpretasi Hasil.....	72
BAB V	PENUTUP	79
5.1	Simpulan	79
5.7	Keterbatasan Penelitian	79
5.8	Saran.....	81
	DAFTAR PUSTAKA	82
	LAMPIRAN-LAMPIRAN	86