

## DAFTAR ISI

	Halaman
<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI .....</b>	<b>ii</b>
<b>PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....</b>	<b>iv</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>v</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>vi</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>vii</b>
<b>KATA PENGANTAR .....</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	10
1.3 Tujuan Penelitian .....	11
1.4 Manfaat Penelitian.....	12
1.5 Sistematika Penulisan .....	13
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b>	
2.1 Landasan Teori.....	15
2.1.1 <i>The Fama-French Three Factor Model</i> .....	15
2.1.2 <i>Efficient Market Hypothesis</i> .....	15
2.1.2.1 Bentuk Pasar Efisien.....	19
2.1.3 Teori <i>Mispricing</i> .....	23
2.1.4 <i>Mean Reversion</i> .....	26
2.1.5 <i>Risk Premium</i> .....	29
2.1.6 <i>Variance Ratio</i> .....	29
2.1.7 <i>Size</i> .....	31
2.1.8 <i>Book-to-market ratio</i> .....	31
2.1.9 Definisi dan Jenis <i>Return Saham</i> .....	33
2.1.10 Pengaruh <i>Stock Mispricing</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	34

2.1.11 Pengaruh <i>Size</i> dan <i>Book-to-Market</i> terhadap <i>Return Saham</i> ...	35
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis .....	38
2.4 Hipotesis Penelitian.....	38
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	41
3.1.1 Variabel Penelitian .....	41
3.1.1.1 Variabel Terikat ( <i>dependentvariable</i> ).....	41
3.1.1.2 Variabel Bebas ( <i>independentvariable</i> ).....	41
3.2 Populasi dan Sampel .....	44
3.3 Jenis dan Sumber Dana .....	46
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	46
3.5 Metode Analisis .....	47
3.5.1 Uji Asumsi Klasik.....	48
3.5.1.1 Uji Normalitas.....	48
3.5.1.2 Uji Multikolinieritas.....	49
3.5.1.3 Uji Heterokedastisitas .....	49
3.5.1.4 Uji Autokorelasi .....	50
3.5.2 Uji Hipotesis .....	51
3.5.5.1 Uji T .....	51
3.5.5.2 Uji F .....	52
<b>BAB IV HASIL DAN ANALISIS</b>	
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	54
4.2 Analisis Data .....	55
4.2.1 Statistik Deskriptif .....	55
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	58
4.2.2.1 Uji Normalitas.....	58
4.2.2.2 Uji Multikolinieritasi.....	61
4.2.2.3 Uji Autokorelasi .....	62
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas .....	63
4.2.3 Analisis Regresi Berganda .....	65
4.2.4 Pengujian Hipotesis.....	66
4.2.4.1 Uji Hipotesis Secara parsial (Uji T).....	66
4.2.4.2 Uji Hipotesis Secara Simultan (Uji F) .....	67
4.2.4.3 Uji Koefisien Determinan $R^2$ .....	68
4.3 Interpretasi Hasil .....	69
4.3.1 Variabel <i>Size</i> .....	69

4.3.2	Variabel <i>Market toBookValue</i> .....	70
4.3.3	Variabel <i>Beta</i> .....	71
4.3.4	Variabel <i>VarianceRatio</i> .....	72
<b>BAB V PENUTUP</b>		
5.1	Kesimpulan .....	74
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	77
5.3	Saran .....	78
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>80</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>83</b>