

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.6 Lingkup Penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	6
BAB II	8
LANDASAN TEORI	8
2.1 Landasan Teori	8
2.2 Penelitian Terdahulu	15
2.3 Sistematika Penelitian	18
BAB III	20
METODE PENELITIAN	20
3.1 Jenis dan Sumber Data	20
3.2 Populasi dan Sampel	20
3.3 Metode Pengumpulan Data	21
3.4 Definisi Operasional Variabel	21
3.4 Konstruksi Portofolio	26
3.5 Metode Analisis Data	27
BAB IV	37
HASIL PENELITIAN	37
4.1 Statistik Deskriptif	37
4.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel	42
4.3 Uji Asumsi Klasik	44
4.4 Regresi Data Panel	45
4.5 Diskusi dan Pembahasan	48
BAB V	53
KESIMPULAN DAN SARAN	53



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**PERBANDINGAN MODEL FAMA FRENCH LIMA FAKTOR DENGAN MODEL ASSET PRICING LAIN
DALAM MEMPREDIKSI RETURN
SAHAM**

CITRA KUMALA DEWI I, Eddy Junarsin, M.B.A., Ph.D., C.F.P.

Universitas Gadjah Mada, 2022 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

5.1 Kesimpulan	53
5.2 Implikasi	55
5.3 Keterbatasan	55
5.4 Saran	55
DAFTAR PUSTAKA	56
LAMPIRAN	62

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Operasional Variabel	25
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif CAPM.....	37
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Model 3 Faktor	39
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Model 4 Faktor	40
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Model 5 Faktor	41
Tabel 4.5 Hasil Uji Chow	42
Tabel 4.6 Hasil Uji Hausman.....	43
Tabel 4.7 Hasil Uji Multikolinearitas	44
Tabel 4.8 Hasil Regresi Data Panel	45
Tabel 4.9 Perbandingan <i>Root</i> MSE dengan Std. Deviasi Variabel Dependen.....	47

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Sistematika Penelitian	18
---	----

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Perusahaan yang Diteliti	62
Lampiran 2. Data Penelitian CAPM	63
Lampiran 3. Data Penelitian Model 3 Faktor	67
Lampiran 4. Data Penelitian Model 4 Faktor	73
Lampiran 5. Data Penelitian Model 5 Faktor	81
Lampiran 6. Statistik Deskriptif CAPM	89
Lampiran 7. Statistik Deskriptif Model 3 Faktor	89
Lampiran 8. Statistik Deskriptif Model 4 Faktor	89
Lampiran 9. Statistik Deskriptif Model 5 Faktor	89
Lampiran 10. Uji Multikolinearitas CAPM	89
Lampiran 11. Uji Multikolinearitas Model 3 Faktor	90
Lampiran 12. Uji Multikolinearitas Model 4 Faktor	90
Lampiran 13. Uji Multikolinearitas Model 5 Faktor	90
Lampiran 14. Uji <i>Common Effect</i> CAPM	90
Lampiran 15. Uji <i>Common Effect</i> Model 3 Faktor	91
Lampiran 16. Uji <i>Common Effect</i> Model 4 Faktor	91
Lampiran 17. Uji <i>Common Effect</i> Model 5 Faktor	91
Lampiran 18. Uji <i>Fixed Effect</i> CAPM	92
Lampiran 19. Uji <i>Fixed Effect</i> Model 3 Faktor	92
Lampiran 20. Uji <i>Fixed Effect</i> Model 4 Faktor	93
Lampiran 21. Uji <i>Fixed Effect</i> Model 5 Faktor	93
Lampiran 22. Uji <i>Random Effect</i> CAPM	94
Lampiran 23. Uji <i>Random Effect</i> Model 3 Faktor	94
Lampiran 24. Uji <i>Random Effect</i> Model 4 Faktor	95
Lampiran 25. Uji <i>Random Effect</i> Model 5 Faktor	95
Lampiran 26. Uji Hausman CAPM	96
Lampiran 27. Uji Hausman Model 3 Faktor	96
Lampiran 28. Uji Hausman Model 4 Faktor	96
Lampiran 29. Uji Hausman Model 5 Faktor	97