



DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
PRAKATA	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
ABSTRACT	x
INTISARI	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1. Latar Belakang	1
1.1 Perumusan Masalah	5
1.2 Keaslian Penelitian	5
1.3 Faedah	5
2. Tujuan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	7
1. Tinjauan Pustaka	7
2. Landasan Teori	12
3. Hipotesis	20
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	21
1. Sampel	21
2. Jenis dan Sumber Data	21
3. Jalan Penelitian	21
4. Variabel	23
5. Metode Analisis	25
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	29
1. Jumlah Perusahaan di Bursa Efek Jakarta	29
2. Hasil dan Pembahasan	30
2.1 Uji asumsi analisis regresi linear	30
2.2 Pengaruh <i>market, size</i> , dan BE/ME terhadap <i>excess return</i>	35
2.3 Pengaruh <i>market</i> terhadap <i>excess return</i>	39
2.4 Perbandingan antara Fama dan French dengan CAPM	42
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	44
1. Kesimpulan	44
2. Saran	45
DAFTAR PUSTAKA	46
LAMPIRAN	48



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1. Jumlah perusahaan yang terdaftar di BEJ selama 1999 – 2002	29
Tabel 2. Jumlah saham dalam portofolio yang terbentuk	30
Tabel 3. Nilai <i>asympt. Sig (2-tailed)</i> dari uji Kolmogorov-Smirnov	31
Tabel 4. Nilai Tolerance dan VIF model Fama dan French	32
Tabel 5. Nilai koefisien korelasi model Fama dan French	32
Tabel 6. Nilai <i>Eigenvalue</i> dan <i>Condition Index</i> (CI) model Fama dan French	32
Tabel 7. Hasil pengujian autokorelasi model Fama dan French	33
Tabel 8. Hasil pengujian autokorelasi model CAPM	34
Tabel 9. Hasil regresi model Fama dan French	35
Tabel 10. Hasil regresi model CAPM	39



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Capital asse pricing model dan tiga faktor model Fama dan French di Bursa Efek Jakarta periode 1999-2002

RAHMAWATI, Alfi, Prof.Dr. Abdul Halim, MBA

Universitas Gadjah Mada, 2003 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1. Pengurangan risiko dengan diversifikasi	14
Gambar 2. Beta suatu saham yang ditunjukkan dari kemiringan garis yang menunjukkan hubungan <i>excess return of market portfolio</i> dengan <i>excess return of stock</i>	16
Gambar 3. Aturan membandingkan uji Durbin-Watson dengan tabel D-W	28



DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1. Return portofolio B/H Juli – Desember 1999	48
Lampiran 2. Return portofolio B/H Januari - Juni 2000	49
Lampiran 3. Return portofolio S/H Juli – Desember 1999	50
Lampiran 4. Return portofolio S/H Januari - Juni 2000	51
Lampiran 5. Return portofolio B/L Juli – Desember 1999	52
Lampiran 6. Return portofolio B/L Januari - Juni 2000	53
Lampiran 7. Return portofolio S/L Juli – Desember 1999	54
Lampiran 8. Return portofolio S/L Januari - Juni 2000	55
Lampiran 9. Return portofolio B/M Juli – Desember 1999	56
Lampiran 10. Return portofolio B/M Januari - Juni 2000	57
Lampiran 11. Return portofolio S/M Juli – Desember 1999	58
Lampiran 12. Return portofolio S/M Januari - Juni 2000	59
Lampiran 13. Return portofolio B/H Juli – Desember 2000	60
Lampiran 14. Return portofolio B/H Januari - Juni 2001	61
Lampiran 15. Return portofolio S/H Juli – Desember 2000	62
Lampiran 16. Return portofolio S/H Januari - Juni 2001	64
Lampiran 17. Return portofolio B/L Juli – Desember 2000	66
Lampiran 18. Return portofolio B/L Januari - Juni 2001	68
Lampiran 19. Return portofolio S/L Juli – Desember 2000	70
Lampiran 20. Return portofolio S/L Januari - Juni 2001	71
Lampiran 21. Return portofolio B/M Juli – Desember 2000	72
Lampiran 22. Return portofolio B/M Januari - Juni 2001	74
Lampiran 23. Return portofolio S/M Juli – Desember 2000	76
Lampiran 24. Return portofolio S/M Januari - Juni 2001	78
Lampiran 25. Return portofolio B/H Juli – Desember 2001	80
Lampiran 26. Return portofolio B/H Januari - Juni 2002	81
Lampiran 27. Return portofolio S/H Juli – Desember 2001	82
Lampiran 28. Return portofolio S/H Januari - Juni 2002	84



Lampiran 29. Return portofolio B/L Juli – Desember 2001	86
Lampiran 30. Return portofolio B/L Januari - Juni 2002	88
Lampiran 31. Return portofolio S/L Juli – Desember 2001	90
Lampiran 32. Return portofolio S/L Januari - Juni 2002	91
Lampiran 33. Return portofolio B/M Juli – Desember 2001	92
Lampiran 34. Return portofolio B/M Januari - Juni 2002	94
Lampiran 35. Return portofolio S/M Juli – Desember 2001	96
Lampiran 36. Return portofolio S/M Januari - Juni 2002	98
Lampiran 37. Return semua portofolio dan return SBI	100
Lampiran 38. Excess return portofolio, return market (IHSG), SMB dan HML	101
Lampiran 39. Uji normalitas model Fama & French	102
Lampiran 40. Uji normalitas model CAPM	105
Lampiran 41. Uji normalitas Kolmogorov-Smirnov	108
Lampiran 42. Uji heteroskedastisitas model Fama & French	109
Lampiran 43. Uji heteroskedastisitas model CAPM	112
Lampiran 44. Hasil regresi model Fama dan French	115
Lampiran 45. Hasil regresi model CAPM	127