



DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN.....	i
INTISARI.....	ii
ABSTRAKSI.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	viii
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	
B. Permasalahan	
C. Tujuan Penelitian	
D. Manfaat Penelitian	
E. Hipotesa	
F. Sistematika Pembahasan	
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA DAN LANDASAN TEORI.....	10
A. Tinjauan Pustaka	
B. Landasan Teori	
C. Hipotesis	
BAB III. METODE PENELITIAN.....	29
A. Sampel Penelitian	
B. Data Penelitian	
C. Diskripsi Variabel	
D. Metode Analisis Data	
BAB IV. ANALISIS DATA.....	51
A. Pengujian Normalitas Data	
B. Uji Asumsi Klasik	
C. Uji Hipotesis	



BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	85
A. Kesimpulan	
B. Saran	
 DAFTAR PUSTAKA.....	 89
 LAMPIRAN-LAMPIRAN	



DAFTAR TABEL

Tabel	1.	Hasil Analisis Regresi Fama dan French <i>Three Factor Model</i>
Tabel	2a	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio S/L
Tabel	2b	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio S/M
Tabel	2c	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio S/H
Tabel	2d	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio B/L
Tabel	2e	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio B/M
Tabel	2f	Tabel <i>Collinearity Statistic Test</i> Portofolio B/H
Tabel	3a	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio S/L
Tabel	3b	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio S/M
Tabel	3c	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio S/H
Tabel	3d	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio B/L
Tabel	3e	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio B/M
Tabel	3f	Tabel Uji Statistik Durbin Watson Portofolio B/H
Tabel	4	Hasil Pengujian Analisis Regresi Hipotesis Pertama
Tabel	5	Hasil Pengujian Analisis Regresi Hipotesis Kedua
Tabel	6a	Hasil Pengujian Analisis Regresi Hipotesis Ketiga Periode Kontraksi
Tabel	6b	Hasil Pengujian Analisis Regresi Hipotesis Ketiga Periode Ekspansi



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1a	Normal Probability Plot Portofolio S/L
Gambar 1b	Normal Probability Plot Portofolio S/M
Gambar 1c	Normal Probability Plot Portofolio S/H
Gambar 1d	Normal Probability Plot Portofolio B/L
Gambar 1e	Normal Probability Plot Portofolio B/M
Gambar 1f	Normal Probability Plot Portofolio B/H
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio S/L
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio S/M
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio S/H
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio B/L
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio B/M
Gambar 2a	Scatterplot Portofolio B/H