



DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Gambar	ix
Daftar Tabel	x
Daftar Lampiran	xi
Intisari	xiii
Abstrak	xiv

BAB I. PENDAHULUAN

I. 1. Latar Belakang	1
I. 2. Perumusan Masalah	6
I. 3. Batasan Masalah	6
I. 4. Tujuan Penelitian	7
I. 5. Manfaat Penelitian	7

BAB II. LANDASAN TEORI DAN PERUMUSAN HIPOTESIS

II. 1. Return dan Resiko Investasi	9
II. 1. 1. Return Investasi	9
II. 1. 2. Resiko Investasi	11
II. 2. Model Keseimbangan	12
II. 3. Pengujian terhadap CAPM	15



II. 4. Model Tiga Faktor Fama dan French	17
II. 5. Pengujian terhadap Model Tiga Faktor Fama dan French	20
II. 6. Perumusan Hipotesis	25

BAB III. METODOLOGI PENELITIAN

III. 1. Data	26
III. 2. Pemilihan Sampel	27
III. 3. Metode Analisis Data	29
III. 3. 1. Pembentukan Portofolio berdasarkan Ranking rasio BMV – dan Size	29
III. 3. 2. Perhitungan Return	31
III. 3. 3. Model Empiris Penelitian	33
III. 4. Pengujian Kenormalan Data dan Asumsi Klasik	34
III. 4. 1. Uji Normalitas	34
III. 4. 2. Uji Multikolinearitas	34
III. 4. 3. Uji Autokorelasi	36
III. 5. Pengujian Hipotesis	37

BAB IV. HASIL DAN DISKUSI

IV. 1. Sampel Penelitian	39
IV. 2. Hasil Pengujian Kenormalan Data dan Asumsi Klasik	41
IV. 2. 1. Variabel Dependen SL.....	41
IV. 2. 2. Variabel Dependen SM	42
IV. 2. 3. Variabel Dependen SH.....	43



IV. 2. 4. Variabel Dependen BL.....	44
IV. 2. 5. Variabel Dependen BM.....	44
IV. 2. 6. Variabel Dependen BH	45
IV. 3. Hasil Pengujian Hipotesis	45
IV. 3. 1. Hasil Uji t	45
IV. 3. 2. Hasil Uji F	50
 BAB V. KESIMPULAN, KETERBATASAN DAN SARAN	
V. 1. Kesimpulan	51
V. 2. Keterbatasan	54
V. 3. Saran	54
Daftar Pustaka	56



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2. 1. Capital Market Line dan Komponen Slopes	14
Gambar 3. 1. Daerah Kritis Uji Durbin-Watson	37



DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1. Koefisien, t hit, p-value dan adjusted R2 dari Hasil Regresi	
Variabel Independen β	46
Tabel 4. 2. Koefisien, t hit, p-value dan adjusted R2 dari Hasil Regresi	
Variabel Independen β , Size.....	47
Tabel 4. 3. Koefisien, t hit, p-value dan adjusted R2 dari Hasil Regresi	
Variabel Independen β , Size.....	48



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Ranking Saham Desember 1997	60
Lampiran 2: Ranking Saham Desember 1998	62
Lampiran 3: Ranking Saham Desember 1999	64
Lampiran 4: Ranking Saham Desember 2000	66
Lampiran 5: Ranking Saham Desember 2001	68
Lampiran 6: Return Portofolio 1997-1998	70
Lampiran 7: Return Portofolio 1998-1999	70
Lampiran 8: Return Portofolio 1999-2000	71
Lampiran 9: Return Portofolio 2000-2001	71
Lampiran 10: Return Portofolio 2001-2002	72
Lampiran 11: Return Market	72
Lampiran 12: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen Variabel SL pada Program SPSS.....	73
Lampiran 13: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen Variabel SM pada Program SPSS.....	74
Lampiran 13: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen Variabel SH pada Program SPSS.....	75
Lampiran 14: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen Variabel BL pada Program SPSS.....	76
Lampiran 15: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen Variabel SH pada Program SPSS.....	77
Lampiran 16: Hasil Uji Normalitas, Asumsi Klasik dan Regresi Dependen	



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis pengaruh Beta, Size, dan Rasio book-to-market terhadap return saham
TONTIAN, Farul, Prof.Dr. Eduardus Tandelilin, MBA

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

xii

Variabel BH pada Program SPSS.....78