

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
PRAKATA.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
ABSTRACT.....	xi
INTISARI.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	6
1.3. Keaslian Penelitian.....	6
1.4. Tujuan Penelitian.....	7
1.5. Faedah Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1. Tinjauan Pustaka	8
2.2. Landasan Teori.....	11
2.3. Hipotesis.....	13

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1. Sumber Data dan Data yang Digunakan.....	14
3.2. Populasi dan Penentuan Sampel.....	14
3.3. Jalan Penelitian.....	15
3.4. Definisi Operasional Variabel	17
3.5. Metode Analisis.....	19

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1. Gambaran Umum Data.....	20
4.2. Hasil Analisis dan Pengujian Hipotesis.....	21
4.2.1. Pengaruh <i>market, size</i> , dan BE/ME terhadap <i>excess return</i>	21
4.2.2. Pengaruh <i>January effect</i> terhadap <i>excess return</i>	28
4.2.3. Uji asumsi analisis regresi linear.....	29

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1. Kesimpulan.....	36
5.2. Saran.....	37
DAFTAR PUSTAKA.....	38
LAMPIRAN.....	40

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1. Uji normalitas model Fama & French.....	40
Lampiran 2. Uji normalitas Kolmogorov-Smirnov.....	44
Lampiran 3. Uji Heteroskedastisitas Model Fama dan French.....	45
Lampiran 4. Regresi Linear Berganda Model Fama dan French.....	49
Lampiran 5. Regresi Berganda Variabel Dummy Efek Januari.....	65
Lampiran 6. Excess Return (Portofolio dan Market), IHSG, SMB, dan HML Juli 1999 s/d Juni 2002.....	72
Lampiran 7. Portofolio BH (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	74
Lampiran 8. Portofolio SH (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	75
Lampiran 9. Portofolio BL (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	77
Lampiran 10. Portofolio SL (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	79
Lampiran 11. Portofolio BM (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	80
Lampiran 12. Portofolio SM (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 1999 s/d Juni 2000).....	82
Lampiran 13. Portofolio BH (Size 2000, PBV1999, BE/ME 1999, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	84

Lampiran 14. Portofolio SH (Size 2000, PBV1999, BE/ME 1999, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	85
Lampiran 15. Portofolio BL (Size 2000, PBV1999, BE/ME 1999, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	87
Lampiran 15. Portofolio SL (Size 1999, PBV1998, BE/ME 1998, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	88
Lampiran 16. Portofolio BM (Size 2000, PBV1999, BE/ME 1999, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	89
Lampiran 17. Portofolio SM (Size 2000, PBV1999, BE/ME 1999, dan Return Juli 2000 s/d Juni 2001).....	91
Lampiran 18. Portofolio BH (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	93
Lampiran 19. Portofolio SH (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	94
Lampiran 20. Portofolio BL (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	96
Lampiran 21. Portofolio SL (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	98
Lampiran 22. Portofolio BM (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	99
Lampiran 23. Portofolio SM (Size 2001, PBV2000, BE/ME 2000, dan Return Juli 2001 s/d Juni 2002).....	101

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1. Jumlah perusahaan yang terdaftar di BEJ Desember 1998 Sampai dengan Juni 2002.....	20
Tabel 2. Jumlah saham dalam portofolio Juni 1998 - Juni 2002.....	21
Tabel 3. Hasil regresi linear berganda model Fama dan French.....	22
Tabel 4. Hasil regresi variabel dummy efek bulan Januari.....	28
Tabel 5. Hasil pengujian multikolinearitas regresi berganda model Fama dan French.....	32
Tabel 6. Hasil pengujian autokorelasi regresi berganda model Fama dan French.....	34