

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT.....	xii
 BAB I PENDAHULUAN	
I.1. Latar Belakang Masalah.....	1
I.2. Perumusan Masalah.....	4
I.3. Pembatasan Masalah.....	4
I.4. Tujuan Penelitian.....	5
I.5. Manfaat Penelitian.....	5
 BAB II LANDASAN TEORI DAN PERUMUSAN HIPOTESIS	
II.1. Model Keseimbangan CAPM.....	7
II.2. Pengujian Awal CAPM.....	10
II.3. Pengujian CAPM oleh Fama dan MacBeth (1973).....	13

II.4. Pengujian dan Penelitian CAPM oleh Fama dan French (1992).....	16
II.5. Peninjauan terhadap Penelitian Fama dan French (1992).....	20
II.6. Teori Faktor Beta.....	22
II.7. Penelitian Fama dan French (1995).....	24
II.8. Penelitian Robert R. Grauer (1999).....	25
II.9. Perumusan Hipotesis.....	26
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
III.1. Populasi dan Penentuan Sampel Penelitian .....	29
III.2. Pengumpulan Data .....	30
III.3. Identifikasi dan Pengukuran Variabel.....	32
III.4. Model Analisis .....	36
III.5. Pengujian Model .....	39
<b>IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN</b>	
IV.1. Sampel Penelitian .....	41
IV.2. Pengujian Hipotesis Pertama.....	43
IV.3. Pengujian Hipotesis Kedua.....	45
IV.4. Pengujian Hipotesis Ketiga .....	47
IV.5. Pengujian Pengaruh BMV dan Size terhadap Rata-rata Return.....	50
IV.6. Pengujian Pengaruh Beta, BMV dan Size terhadap Rata-rata Return.....	54
IV.7. Uji Normalitas.....	58



UNIVERSITAS  
GADJAH MADA

**Analisis pengaruh beta, rasio book to market value (BMV) dan size terhadap rata-rata return saham pada Bursa Efek Indonesia**

ANGGONO, Susilo Tri, Suad Husnan, Dr., MBA

Universitas Gadjah Mada, 2009 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

## V KESIMPULAN DAN SARAN

V.I. Kesimpulan.....	59
V.I. Saran – saran .....	61
DAFTAR PUSTAKA.....	63