

DAFTAR ISI

HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR LAMPIRAN.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
ABSTRAK.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	3
1.4 Manfaat Penelitian.....	4
1.5 Sistematika Penelitian.....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	7
2.1 Landasan Teori.....	7
2.1.1 Pasar Modal Indonesia	7
2.1.2 Risiko dan <i>Return</i>	9
2.1.3 Model Tiga Faktor Fama dan French.....	11
2.1.4 Model Empat Faktor Carhart.....	13
2.1.5 Model Lima Faktor Fama dan French.....	16

2.2 Tinjauan penelitian sebelumnya.....	17
2.3 Sistematika Penelitian	19
BAB III METODE PENELITIAN.....	21
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	21
3.2 Populasi dan Sampel.....	21
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	21
3.4 Definisi Operasional Variabel.....	22
3.5 Metode Analisis Data.....	24
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	30
4.1 Hasil Perhitungan MAD Model Tiga Faktor Fama dan French.....	30
4.2 Hasil Perhitungan MAD Model Empat Faktor Carhart.....	40
4.3 Hasil Perhitungan MAD Model Lima Faktor Fama dan French.....	48
4.4 Perbandingan MAD dan indeks Sharpe antara Ketiga Model Perhitungan Dalam Memprediksi Return Saham.....	57
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	59
5.1 Kesimpulan.....	59
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	59
5.3 Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA.....	61

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Nilai Alpha, Beta Pasar, Return Premium KOMPAS100, Beta SMB, SMB, Beta HML, dan HML.....	63
Lampiran 2 Nilai Alpha, Beta Pasar, Return Premium KOMPAS100, Beta SMB, SMB, Beta HML, HML, Beta Momentum, dan Momentum.....	67
Lampiran 3 Nilai Alpha, Beta Pasar, Return Premium KOMPAS100, Beta SMB, SMB, Beta HML, HML, Beta RMW, RMW, Beta CMA, dan CMA.....	70

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Sistematika Penelitian.....	19
--	----

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Hasil <i>MAD</i> Model Tiga Faktor Fama dan French.....	34
Tabel 4.2 Hasil Indeks Sharpe Model Tiga Faktor Fama dan French.....	37
Tabel 4.3 Hasil <i>MAD</i> Model Empat Faktor Carhart	42
Tabel 4.4 Hasil Indeks Sharpe Model Empat Faktor Carhart	45
Tabel 4.5 Hasil <i>MAD</i> Model Lima Faktor Fama dan French.....	51
Tabel 4.6 Hasil Indeks Sharpe Model Lima Faktor Fama dan French.....	54
Table 4.7 <i>MAD</i> Model Tiga Faktor Fama dan French, Model Empat Faktor Carhart, dan Model Lima Faktor Fama dan French.....	57
Table 4.8 Indeks Sharpe Model Tiga Faktor Fama dan French, Model Empat Faktor Carhart, dan Model Lima Faktor Fama dan French.....	58