

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN.....	viii
DAFTAR ISTILAH	ix
INTISARI.....	x
ABSTRAC	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
I.1. Latar Belakang	1
I.2. Pertanyaan Penelitian	3
I.3. Tujuan Penelitian.....	4
I.4. Manfaat Penelitian.....	4
BAB II GAMBARAN UMUM.....	6
II.1. Kondisi Umum Penulisan.....	6
II.1.1. <i>Fama French Three Factor Model</i>	6
II.1.2. Return Saham	9
II.1.3. Indeks LQ 45.....	10
II.2. Tinjauan Pustaka	11
II.3. Keaslian Penelitian	12
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	14
III.1. Desain Penelitian	14
III.2. Jenis dan Sumber Data.....	14
III.3. Teknik Pengumpulan Data.....	14
III.4. Sampel	15
III.5. Definisi Operasional Variabel	16
III.5.1. Premi Risiko	16
III.5.2 <i>Firm Size</i>	17

III.5.3.	<i>Book to market ratio</i>	18
III.5.4.	<i>Risk Free (Rf)</i>	21
III.5.5.	<i>Return Saham</i>	21
III.6.	Teknik Analisis Data	21
III.6.1.	Uji Normalitas	22
III.6.2.	Uji Asumsi Klasik	22
III.6.3.	Analisis Regresi Linier Berganda.....	23
III.6.4.	Uji Hipotesis	24
III.6.5.	Koefisien Determinasi (R^2)	24
III.7.	Rumusan Hipotesis	24
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		27
IV.1.	Analisis	27
IV.1.1.	Statistik Deskriptif.....	27
IV.1.2.	Uji Normalitas	29
IV.1.3.	Uji Asumsi Klasik	29
IV.1.4.	Analisis Regresi Linier Berganda.....	31
IV.1.5.	Uji Hipotesis	31
IV.1.6.	Koefisien Determinasi (R^2)	32
IV.2.	Pembahasan	33
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		36
V.1.	Kesimpulan.....	36
V.2.	Keterbatasan penelitian	37
V.3.	Saran	37
DAFTAR PUSTAKA		38
LAMPIRAN		40