

Daftar Isi

Halaman judul.....	i
Lembar pengesahan.....	ii
Lembar pernyataan keaslian.....	iii
Motto dan Persembahan.....	iv
Kata Pengantar.....	v
Daftar isi.....	vii
Daftar tabel.....	viii
Abstract.....	ix
Intisari.....	x
Bab I. Pendahuluan.....	1
1. Latar Belakang Masalah.....	1
2. Rumusan Masalah.....	8
3. Batasan Masalah.....	9
4. Tujuan Penelitian.....	10
5. Manfaat Penelitian.....	10
Bab II. Tinjauan Teori dan Hipotesis.....	11
1. Review Penelitian Terdahulu.....	11
2. Investasi: Return dan Risiko.....	16
3. Capital Asset Pricing Model.....	20
4. Model Tiga Faktor.....	22
5. Hipotesis.....	24
Bab III. Metoda Penelitian.....	26
1. Tipe dan Sumber Data.....	26
2. Sampel.....	27
3. Proses Pengujian.....	29
3.1. Pengujian CAPM.....	29
3.2. Pengujian Model Tiga Faktor.....	31
Bab IV. Analisis Data.....	36
1. Sampel.....	36
2. Analisis Pengujian CAPM.....	39
2.1. Analisis Regresi Time Series.....	39
2.2. Analisis Regresi Cross Sectional.....	45
3. Analisis Pengujian Model Tiga Faktor.....	49
3.1. Analisis Regresi Time Series.....	49
3.2. Analisis Regresi Cross Sectional.....	54
Bab V. Simpulan, Keterbatasan, Implikasi dan Rekomendasi.....	58
1. Simpulan.....	58
2. Keterbatasan.....	59
3. Implikasi.....	59
4. Rekomendasi.....	60
Daftar Pustaka.....	62