

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN .....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTO DAN PERSEMBAHAN .....	v
<i>ABSTRACT</i> .....	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR .....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
<b>BAB I</b>	<b>PENDAHULUAN</b>
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	6
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian .....	7
1.3.1 Tujuan Penelitian .....	7
1.3.2 Manfaat Penelitian .....	7
1.4 Sistematika Penulisan .....	8
<b>BAB II</b>	<b>TELAAH PUSTAKA</b>
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu .....	10
2.1.1 Portofolio Pasar.....	10
2.1.2 Konsep Return dan Resiko.....	11
2.1.2.1 Return Portofolio.....	13
2.1.2.2 Abnormal Return .....	13
2.1.2.3 Resiko Portofolio .....	13
2.1.2.4 Hubungan Return dan Resiko Portofolio .....	14
2.1.3 Teori Penilaian Aset.....	15
2.1.4 Model Penilaian Aset .....	16
2.1.4.1 Capital Asset Pricing Model.....	16
2.1.4.2 Fama dan French Model Tiga Faktor .....	18
2.1.5 Return Saham .....	20
2.1.6 Book to Market Ratio .....	20
2.1.7 Expected Return .....	21
2.1.8 Perbedaan Metode Penilaian Aset.....	21
2.2 Penelitian terdahulu .....	23
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis dan pengembangan hipotesis .....	26

<b>BAB III</b>	<b>METODOLOGI PENELITIAN</b>	
	3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	
	Variabel .....	28
	3.1.1 Beta Pasar .....	28
	3.1.2 Firm Size .....	29
	3.1.3 Book to Market Ratio .....	29
	3.1.4 Return Saham.....	29
	3.2 Populasi dan Sampel .....	30
	3.3 Jenis dan Sumber Data.....	30
	3.4 Metode Pengumpulan Data.....	30
	3.5 Metode analisis .....	31
	3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	31
	3.5.2 Uji Normalitas.....	31
	3.5.3 Uji Hipotesis .....	32
<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	
	4.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	33
	4.1.1 Deskripsi Return Saham .....	36
	4.1.2 Deskripsi Return Pasar .....	38
	4.1.3 Deskripsi Ukuran dan Pertumbuhan Perusahaan	39
	4.2 Analisis Data .....	42
	4.2.1 Pengujian Model CAPM .....	42
	4.2.2 Pengujian Model Tiga Faktor	
	Fama dan French .....	43
	4.2.3 Pengujian Perbedaan Model CAPM dengan	
	Fama dan French.....	44
	4.3 Uji Normalitas .....	45
	4.4 Pengujian Hipotesis .....	46
<b>BAB V</b>	<b>PENUTUP</b>	
	5.1 Simpulan .....	49
	5.2 Keterbatasan.....	50
	5.3 Saran .....	50
	DAFTAR PUSTAKA .....	51
	LAMPIRAN-LAMPIRAN	