

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRACT	iii
ABSTRAK	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	10
1. Tujuan Penelitian	10
2. Kontribusi Penelitian	11
BAB II KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka	12
1. <i>Assets Pricing</i>	12
a) <i>Return</i>	12
b) <i>Abnormal Return</i>	13
c) Valuasi.....	16
2. <i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	16
3. Teori Portofolio	18
4. Fama and French	19
a) <i>Fama and French Three Factors Model</i>	19
b) <i>Fama and French Five Factors Model</i>	22
5. Bank	24
a) Pengertian Bank	24
b) Fungsi-fungsi Bank	24
6. Penelitian Terdahulu	26
B. Rerangka Pemikiran	30
C. Hipotesis	31

BAB III METODE PENELITIAN

A.	Waktu dan Tempat Penelitian	34
B.	Desain penelitian	34
C.	Definisi dan operasionalisasi variable	34
1.	. Variabel Independen	35
a)	<i>Market Risk Premium (Rm)</i>	35
b)	<i>Small Minus Big (SMB)</i>	36
c)	<i>High Minus Low (HML)</i>	36
d)	<i>Robust Minus Weakness/Profitability (RMW)</i>	38
e)	<i>Conservative Minus Aggressive/Investment (CMA)</i>	38
2.	Variabel Dependen	39
D.	Populasi dan Sampel Penelitian	40
1.	Populasi	40
2.	Sampel	40
E.	Teknik Pengumpulan Data	42
F.	Metode Analisis	42
1.	Analisis Statistik Deskriptif	42
2.	Uji Asumsi Klasik	43
a)	Uji Normalitas	43
b)	Uji Autokorelasi	43
c)	Uji Heteroskedastisitas	44
3.	Uji Multikolinieritas	44
4.	Uji Analisis Regresi Linear Berganda	45
5.	Uji Hipotesis	46
a)	Analisis Koefisien (R ²)	47
b)	Uji Statistic F	47
c)	Uji Statistic t (Uji-t)	48

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A.	Gambaran Umum Objek Penelitian	50
B.	Hasil Uji Statistik Deskriptif	68
C.	Uji Asumsi Regresi Klasik	71
1.	Uji Normalitas	71
2.	Uji Autokorelasi	72
3.	Uji Heteroskedastisitas	72
D.	Uji Multikolinearitas	73
E.	Analisis Regresi Linear Berganda	74

F. Uji Model	76
1. Uji Koefisien Determinasi (R^2)	76
2. Uji Simultan F (Uji F)	77
3. Uji Statistik t	78
G. Pembahasan Hasil Penelitian	80

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	82
B. Saran	83

DAFTAR PUSTAKA

