

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Model Penilaian Asset (<i>Asset Pricing Model</i>)	35
Tabel 4.2 Pengurutan Bivariat <i>Size</i> dan <i>Book/Market</i>	39
Tabel 4.3 Pengurutan Bivariat <i>Size</i> dan <i>Profitability</i>	39
Tabel 4.4 Pengurutan Bivariat <i>Size</i> dan <i>Investasi</i>	40
Tabel 4.5 Perhitungan Faktor	40
Tabel 4.6 Pengambilan keputusan ada tidaknya autokorelasi	45
Tabel 5.1 Statistik Deskriptif Faktor <i>Asset Pricing</i>	49
Tabel 5.2 Statistik Deskriptif Korelasi Antar Variabel Independen.....	50
Tabel 5.3 Statistik Deskriptif <i>Excess Return</i> Porotfolio 2008-2017	51
Tabel 5.4 Hasil Pengujian Stasioneritas dengan Metode <i>ADF</i>	52
Tabel 5.5. Hasil Uji Autokorelasi pada Fama French Lima Faktor	56
Tabel 5.6. Hasil Uji Autokorelasi pada Fama French Tiga Faktor.....	56
Tabel 5.7. Hasil Uji Multikolinieritas pada FF5F	58
Tabel 5.8. Hasil Uji Nilai Tolerance dan <i>VIF</i> pada FF5F	58
Tabel 5.9. Hasil Uji Multikolinieritas pada FF3F	59
Tabel 5.10. Hasil Uji Nilai Tolerance dan <i>VIF</i> pada FF3F	59
Tabel 5.11. Hasil Regresi Liner Berganda untuk Model FF3F	60
Tabel 5.12. Hasil Regresi Liner Berganda untuk Model FF5F	61
Tabel 5.13. Hasil Uji F pada FF5F	65
Tabel 5.14. Hasil Uji F pada FF3F.....	65
Tabel 5.15. Hasil Analisis Koefisien Determinasi pada FF3F	70
Tabel 5.16. Hasil Analisis Koefisien Determinasi pada FF5F	70