

## DAFTAR ISI

<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>i</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>ii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>I. PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah .....	6
C. Batasan Penelitian .....	6
D. Tujuan Penelitian .....	7
E. Manfaat Penelitian.....	7
F. Kerangka Teoritis .....	8
G. Hipotesis .....	9
<b>II. TINJAUAN PUSTAKA</b>	
A. Model Tiga Faktor Fama dan French .....	10
B. Kinerja Saham.....	11
C. Risiko Investasi .....	13
D. <i>Size</i> .....	15
E. <i>Book to Market Ratio</i> .....	16
F. Penelitian Terdahulu.....	16
<b>III. METODE PENELITIAN</b>	
A. Objek Penelitian .....	19
B. Metode Pengumpulan Data .....	19
C. Populasi dan Sampel Penelitian.....	19
D. Definisi Operasional Variabel .....	20
E. Jenis dan Sumber Data .....	22

F. Teknik Pengumpulan Data .....	22
G. Teknik Analisis Data .....	22
H. Metode Analisis Data .....	23
I. Model Analisis.....	25

#### **IV. PEMBAHASAN DAN HASIL**

A. Hasil Analisis Regresi Linier Berganda .....	35
B. Uji t.....	37
C. Uji F.....	38
D. Pengaruh <i>Return Market</i> Terhadap Kinerja Saham.....	39
E. Pengaruh <i>Size</i> Terhadap Kinerja Saham.....	40
F. Pengaruh <i>Book to Market Ratio</i> Terhadap Kinerja Saham.....	41

#### **V. KESIMPULAN DAN SARAN**

A. Kesimpulan.....	42
B. Saran .....	43

#### **DAFTAR PUSTAKA**

#### **LAMPIRAN**

## DAFTAR TABEL

<b>Tabel</b>	<b>Hal.</b>
1. Perkembangan Harga Saham Otomotif pada Periode 2010-2011 ..	5
2. Perusahaan- Perusahaan Otomotif yang Menjadi Sampel .....	20
3. Pengertian Enam Group Portofolio .....	25
4. Hasil Uji Normalitas .....	28
5. Hasil Uji Multikolinearitas .....	31
6. Hasil Uji Autokorelasi .....	33
7. Hasil Analisis Regresi Linier Berganda .....	36
8. Ringkasan Hasil Analisis Regresi .....	37
9. Hasil Uji t .....	38
10. Hasil Uji F .....	39

## DAFTAR GAMBAR

<b>Gambar</b>	<b>Hal.</b>
1. Kerangka Pemikiran Penelitian .....	8
2. Histogram Uji Normalitas .....	29
3. Hasil P-Plot .....	30
4. Hasil Uji Heterokedastisitas .....	32
5. Hasil Uji Durbin Watson.....	34

## DAFTAR LAMPIRAN

### Lampiran

1. Indeks Saham Masing-Masing Saham Otomotif
2. *Return* Saham Masing-Masing Saham Otomotif
3. Suku Bunga Bebas Risiko (SBI)
4. Perhitungan *Return* Market
5. *Small Minus Big*
6. *Book to Market Ratio*
7. Standar Deviasi
8. *Premium Return* Masing-Masing Saham Otomotif
9. Hasil Regresi Pengaruh *Return Market*, *Size* dan *Book to Market Ratio* Terhadap *Premium Return*