

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING	
LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN	
KATA PENGANTAR.....	i
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	6
1.3 Pembatasan Masalah.....	6
1.4 Rumusan Masalah.....	7
1.5 Tujuan Penelitian.....	7
1.6 Manfaat Penelitian.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	9
2.1. Kerangka Teori.....	9
2.1.1 <i>Return Saham</i>	9
2.1.2 Risiko Sistematis.....	12
2.1.3 Tingkat Likuiditas.....	18
2.1.4 Pengaruh Risiko Sistematis terhadap <i>Return Saham</i>	20
2.1.5 Pengaruh Tingkat Likuiditas terhadap <i>Return Saham</i>	23
2.2 Penelitian yang Relevan.....	25
2.3 Kerangka Berpikir.....	27

2.4 Hipotesis	29
BAB III METODE PENELITIAN	30
3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian	30
3.2 Populasi dan Sampel	30
3.3 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	31
3.4 Jenis dan Sumber Data	33
3.5 Teknik Pengumpulan Data	33
3.6 Teknik Analisa Data	33
3.6.1 Analisis Regresi Berganda	33
3.6.2 Uji Koefisien Determinasi	34
3.6.3 Uji Hipotesis	35
3.6.4 Uji Asumsi Klasik	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	38
4.1 Hasil Penelitian	38
4.1.1 Gambaran Umum Sampel	39
4.1.2 Deskripsi Data	40
4.2 Hasil Pengujian Data	44
4.2.1 Uji Asumsi Klasik	44
4.2.2 Analisis Statistik	49
4.2.3 Pengujian Hipotesis	50
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	47
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	57
5.1 Kesimpulan	57
5.2 Saran	58
DAFTAR PUSTAKA	59
LAMPIRAN	