

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING	
LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN	
SURAT PERNYATAAN	
ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Identifikasi Masalah.....	7
1.3. Pembatasan Masalah.....	7
1.4. Rumusan Masalah.....	7
1.5. Tujuan Penelitian	8
1.6. Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1. Kerangka Teoritis	10
2.1.1. <i>Return Saham</i>	10
2.1.1.1. Pengertian <i>Return Saham</i>	10
2.1.1.2. Faktor yang Mempengaruhi <i>Return Saham</i>	11
2.1.2. Risiko Sistematis (<i>Systematic Rick</i>).....	12
2.1.3. Likuiditas	15
2.1.4. <i>Firm Size</i>	18
2.2. Penelitian Terdahulu	20
2.3. Kerangka Berpikir	25
2.4. Hipotesis.....	27
BAB III METODE PENELITIAN	28
3.1. Lokasi dan Waktu Penelitan	28
3.2. Populasi dan Sampel.....	28
3.2.1. Populasi.....	28
3.2.2. Sampel.....	28
3.3. Variabel Penelitian dan Defenisi Operasional	29
3.3.1. Variabel Independen	29
3.3.2. Variabel Dependen.....	31
3.4. Teknik Pengumpulan Data	31
3.5. Metode Analisis Data	32
3.5.1. Statistik Deskriptif	32
3.5.2. Uji Asumsi Klasik.....	32
3.5.2.1. Uji Normalitas.....	33

3.5.2.2. Uji Multikoloniaritas	33
3.5.2.3. Uji Autokolerasi.....	34
3.5.2.4. Uji Heterokedastisitas.....	35
3.5.3. Regresi Berganda	35
3.5.4. Pengujian Hipotesis.....	36
3.5.4.1. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	36
3.5.4.2. Uji F.....	36
3.5.4.3. Uji T	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	38
4.1 Gambaran Umum Sampel.....	38
4.2 Hasil Analisis Data	39
4.2.1 Statistik Deskriptif	39
4.2.2 Uji Asumsi Klasik	41
4.2.2.1 Uji Normalitas	41
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas	44
4.2.2.3 Uji Autokolerasi	44
4.2.2.4 Uji Heterokedastisitas	46
4.2.3 Regresi Linear Berganda.....	49
4.2.4 Pengujian Hipotesis	50
4.2.4.1 Koefisien Determinasi (R^2)	50
4.2.4.2 Uji F	51
4.2.4.3 Uji T	52
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	54
BAB V PENUTUP	58
5.1 Kesimpulan	58
5.2 Saran	59
DAFTAR PUSTAKA	60

