

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
RIWAYAT HIDUP.....	v
MOTTO	vi
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
PERSEMBAHAN.....	ix
PRAKATA.....	x
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Ruang Lingkup Penelitian.....	7
1.3 Rumusan Masalah	7
1.4 Tujuan Masalah.....	8
1.5 Manfaat Penelitian	8
1.6 Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Grand Theory	10
2.1.1 Agency Theory.....	10
2.1.2 Signaling Theory	11
2.2 Return Saham.....	11
2.2.1 Pengertian Return Saham	12
2.2.2 Perhitungan Return Saham.....	13
2.2.3 Faktor yang mempengaruhi Return Saham	14

2.3	Risiko Sistematis.....	17
2.3.1	Beta Sebagai Alat Ukur Risiko Sistematis.....	18
2.3.2	Perhitungan Beta.....	20
2.3.3	Hubungan Beta dengan Return Saham.....	20
2.4	Likuiditas Saham.....	21
2.4.1	Pengertian Likuiditas Saham.....	21
2.4.2	TVA sebagai Alat Ukur Likuiditas Saham.....	22
2.5	Penelitian Terdahulu.....	23
2.6	Kerangka Pemikiran.....	25
2.7	Bangunan Hipotesis.....	26
2.7.1	Risiko Sistematis dan Return Saham.....	26
2.7.2	Likuiditas Saham dan Return Saham.....	26

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Jenis dan Sumber Data.....	28
3.1.1	Jenis Data.....	28
3.1.2	Sumber Data.....	28
3.2	Metode Pengumpulan Data.....	28
3.3	Populasi dan Sampel.....	28
3.3.1	Populasi.....	28
3.3.2	Sampel.....	29
3.4	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	29
3.4.1	Variabel Penelitian.....	29
3.4.2	Operasional Variabel.....	30
3.5	Metode Analisis Data.....	32
3.5.1	Statistik Deskriptif.....	32
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	33
3.5.2.1	Uji Normalitas.....	33
3.5.2.2	Uji Multikolonieritas.....	34
3.5.2.3	Uji Autokorelasi.....	35
3.5.2.4	Uji Heteroskedatisitas.....	35
3.5.3	Pengujian Hipotesis.....	36
3.5.3.1	Model Regresi Linier Berganda.....	36
3.5.3.2	Uji Koefisien Determinasi.....	37
3.5.3.3	Uji T.....	38

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Deskripsi Data.....	39
4.1.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	39
4.1.2	Deskripsi Sampel Penelitian.....	39
4.2	Hasil dan Deskriptif.....	40
4.2.1	Analisis Deskriptif.....	40
4.2.2	Uji Asumsi Klasik.....	41

4.2.2.1 Uji Normalitas	41
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas	42
4.2.2.3 Uji Autokorelasi	42
4.2.2.4 Uji Heteroskedastisitas	43
4.3 Uji Hipotesis	44
4.3.1 Uji Regresi Linier Berganda	44
4.3.2 Uji Koefisien Determinasi R^2	46
4.3.3 Uji Kelayakan Model (Uji F)	46
4.3.4 Uji Hipotesis (Uji T)	47
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian	48
4.4.1 Risiko sistematis terhadap return saham	48
4.4.2 Likuiditas saham terhadap return saham	49

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan	50
5.2 Saran	50
5.3 Keterbatasan	50

DAFTAR PUSTAKA	52
-----------------------------	-----------

LAMPIRAN