

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRACT.....	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	8
1.4 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Definisi.....	9
2.1.1 Investor Sentiment Theory.....	9
2.1.2 Momentum.....	10
2.1.3 Rekomendasi Analisis.....	10
2.1.4 Order Imbalance.....	12
2.1.5 Trading Volume Activity.....	13
2.1.6 Return Saham.....	14
2.2 Penelitian Terdahulu.....	15
2.3 Perbedaan Penelitian.....	19
2.4 Pengaruh Antar Variabel.....	21
2.4.1 Pengaruh Rekomendasi Analisis Saham terhadap Return Saham.....	21
2.4.2 Pengaruh <i>Order Imbalance</i> terhadap Return Saham.....	22
2.4.3 Pengaruh Trading Volume Activity terhadap Return Saham.....	22
2.4.4 Pengaruh Momentum terhadap Return Saham.....	23
2.5 Kerangka Pemikiran.....	24
2.6 Perumusan Hipotesis.....	25

BAB III METODE PENELITIAN.....	29
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	29
3.1.1 Variabel Penelitian.....	29
3.1.2 Definisi Operasional.....	29
3.2 Populasi dan Sampel.....	34
3.2.1 Populasi.....	34
3.2.2 Sampel.....	34
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	36
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	37
3.5 Metode Analisis.....	37
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	38
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	39
3.5.3 Uji Hipotesis.....	43
BAB IV HASIL DAN ANALISIS DATA.....	47
4.1 Gambaran Umum dan Statistik Deskriptif.....	47
4.1.1 Gambaran Umum dan Objek Penelitian.....	47
4.1.2 Statistik Deskriptif.....	48
4.2 Analisis Data.....	52
4.2.1 Uji Asumsi Klasik.....	52
4.2.2 Uji Hipotesis.....	57
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	62
4.3.1 Pengaruh Rekomendasi Analisis (ANR) Terhadap Return Saham.....	63
4.3.2 Pengaruh <i>Order Imbalance</i> (OI) Terhadap Return Saham (Return) ..	64
4.3.3 Pengaruh Trading Volume Activity (ANR) Terhadap Return Saham.....	65
4.3.4 Pengaruh Momentum (MOMENTUM) Terhadap Return Saham.....	65
BAB V PENUTUP.....	67
5.1 Kesimpulan.....	67
5.2 Keterbatasan.....	68
5.3 Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....	71
LAMPIRAN.....	77