

## DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI .....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN .....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	v
KATA PENGANTAR.....	viii
<i>ABSTRACT</i> .....	ix
ABSTRAK .....	x
DAFTAR ISI .....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR .....	xv
DAFTAR LAMPIRAN .....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	14
1.3 Tujuan Penelitian .....	15
1.4 Kegunaan Penelitian.....	16
1.5 Sistematika Penulisan.....	17
BAB II TELAAH PUSTAKA.....	19
2.1 Landasan Teori .....	19
2.1.1 Teori <i>Signaling</i> .....	19
2.1.2 Likuiditas .....	21
2.1.3 Informasi Keuangan.....	21
2.1.4 Informasi Pasar .....	22
2.1.5 Dividen .....	23
2.1.6 <i>Capital Gain</i> .....	23
2.2 Penelitian Terdahulu .....	24
2.3 Kerangka Pemikiran .....	40
2.4 Perumusan Hipotesis .....	41
2.4.1 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap <i>Returns</i> Saham .....	41
2.4.2 Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	42

2.4.3 Pengaruh Pertumbuhan Aset Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	43
2.4.4 Pengaruh <i>Return on Asset</i> Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	44
2.4.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> Terhadap <i>Returns</i> Saham .....	46
BAB III METODE PENELITIAN.....	48
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	48
3.1.1 Variabel Dependen .....	48
3.1.2 Variabel Independen .....	49
3.1.2.1 Volume Perdagangan.....	49
3.1.2.2 Kapitalisasi Pasar .....	50
3.1.2.3 Pertumbuhan Aset .....	51
3.1.2.4 ROA .....	52
3.1.2.5 PBV .....	53
3.2 Populasi dan Sampel .....	56
3.2.1 Populasi.....	56
3.2.2 Sampel .....	57
3.3 Jenis dan Sumber Data .....	58
3.4 Metode Pengumpulan Data .....	58
3.5 Metode Analisis .....	59
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif .....	59
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	60
3.5.3 Analisis Regresi Linear Berganda.....	63
3.5.4 Uji F (Simultan).....	64
3.5.5 Uji t (Parsial).....	65
BAB IV HASIL DAN ANALISIS .....	66
4.1 Deskripsi Objek Penelitian .....	66
4.2 Analisis Data.....	68
4.2.1 Hasil Analisis Statistik Deskriptif.....	68
4.2.2 Hasil Uji Asumsi Klasik .....	73
4.2.2.1 Hasil Uji Normalitas Residual .....	74
4.2.2.2 Hasil Uji Multikolinearitas.....	75
4.2.2.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas .....	75
4.2.2.4 Hasil Uji Autokorelasi.....	76

4.2.3 Hasil Uji Hipotesis.....	77
4.2.3.1 Hasil Analisis Regresi Linear Berganda .....	78
4.2.3.2 Hasil Uji Koefisien Determinasi .....	80
4.2.3.3 Hasil Uji Statistik F .....	81
4.2.3.4 Hasil Uji Statistik t.....	82
4.3 Interpretasi Hasil .....	84
4.3.1 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap <i>Returns Saham</i> .....	85
4.3.2 Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap <i>Returns Saham</i> .....	86
4.3.3 Pengaruh Pertumbuhan Aset terhadap <i>Returns Saham</i> .....	87
4.3.4 Pengaruh <i>Returns on Asset</i> terhadap <i>Returns Saham</i> .....	88
4.3.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> terhadap <i>Returns Saham</i> .....	90
BAB V KESIMPULAN .....	92
5.1 Simpulan.....	92
5.2 Keterbatasan .....	94
5.3 Saran.....	95
DAFTAR PUSTAKA.....	97
LAMPIRAN.....	103