

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
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	10
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	11
1.3.1 Tujuan Penelitian	11
1.3.2 Manfaat Penelitian	12
1.3.2.1 Manfaat Teoritis.....	12
1.3.2.2 Manfaat Praktis	12
1.4 Sistematika Penulisan.....	13
BAB II TELAAH PUSTAKA	15
2.1 Landasan Teori	15
2.1.1 Teori <i>Signaling</i>	15
2.1.2 Volume Perdagangan	17
2.1.3 Kapitalisasi Pasar	18

2.1.4	Rasio <i>Book to Market</i>	19
2.1.5	Pertumbuhan Aset	19
2.1.6	<i>Return on Assets</i> (ROA).....	20
2.1.7	<i>Return Saham</i>	21
2.2	Penelitian Terdahulu.....	22
2.3	Kerangka Pemikiran	31
2.4	Hipotesis	32
2.4.1	Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap <i>Return Saham</i>	32
2.4.2	Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Return Saham</i>	32
2.4.3	Pengaruh Rasio <i>Book to Market</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	33
2.4.4	Pengaruh Pertumbuhan Aset Terhadap <i>Return Saham</i>	34
2.4.5	Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) Terhadap <i>Return Saham</i>	35
BAB III METODE PENELITIAN		37
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	37
3.1.1	Variabel Dependen.....	37
3.1.2	Variabel Independen	38
3.2	Populasi dan Sampel	43
3.2.1	Populasi.....	43
3.2.2	Sampel.....	43
3.3	Jenis dan Sumber Data	43
3.4	Metode Pengumpulan Data	44
3.5	Metode Analisis Data	44
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif	44
3.5.2	Uji Asumsi Klasik	45
3.5.3	Analisis Regresi	47

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	50
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	50
4.2 Analisis Data	51
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif	51
4.2.2 Uji Asumsi Klasik	54
4.2.3 Analisis Regresi Linear Berganda.....	56
4.3 Interpretasi Hasil	60
4.3.1 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap <i>Return</i> Saham.....	61
4.3.2 Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Return</i> Saham.....	62
4.3.3 Pengaruh Rasio <i>Book to Market</i> Terhadap <i>Return</i> Saham	63
4.3.4 Pengaruh Pertumbuhan Aset Terhadap <i>Return</i> Saham.....	64
4.3.5 Pengaruh <i>Return on Assets</i> (ROA) Terhadap <i>Return</i> Saham	64
BAB V PENUTUP.....	66
5.1 Kesimpulan.....	66
5.2 Keterbatasan	66
5.3 Saran	67
DAFTAR PUSTAKA.....	69
LAMPIRAN.....	75

FEB UNDIP