

## DAFTAR ISI

COVER.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI .....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	Error! Bookmark not defined.
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 Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	12
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	13
1.4 Sistematika Penulisan.....	16
BAB II TELAAH PUSTAKA .....	17
2.1 Definisi Konsep Variabel .....	17
2.1.1 <i>Return Saham</i> .....	17
2.1.2 <i>Investor Sentiment</i> .....	18
2.1.3 <i>Relative Strength Index</i> .....	19
2.1.4 <i>Analyst Recommendation</i> .....	21
2.1.5 <i>Net Foreign Flow</i> .....	22
2.1.6 <i>Firm Size</i> .....	24
2.1.7 <i>Book to Market</i> .....	25
2.1.8 Indeks LQ45.....	25
2.2 Landasan Teori .....	27
2.2.1 <i>Efficient Market Hypothesis (EMH)</i> .....	27
2.2.2 <i>Behavioral Finance Theory</i> .....	28

2.2.3	<i>Noise Trader Theory</i> .....	29
2.3	Penelitian Terdahulu.....	30
2.4	Hubungan Antar Variabel.....	36
2.4.1	Pengaruh <i>Investor Sentiment</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	36
2.4.2	Pengaruh <i>Relative Strength Index</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	37
2.4.3	Pengaruh <i>Analyst Recommendation</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	39
2.4.4	Pengaruh <i>Net Foreign Flow</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	40
2.5	Kerangka Pemikiran .....	42
BAB III METODE PENELITIAN.....		44
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	44
3.2	Populasi dan Sampel.....	50
3.3	Jenis dan Sumber Data .....	52
3.4	Metode Pengumpulan Data .....	53
3.5	Metode Analisis Data .....	54
3.5.1	Statistik Deskriptif .....	54
3.5.2	Uji Pemilihan Model.....	54
3.5.3	Uji Asumsi Klasik.....	56
3.5.4	Uji Hipotesis.....	61
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		66
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	66
4.2	Analisis Data .....	67
4.2.1	Statistik Deskriptif .....	67
4.2.2	Uji Pemilihan Model.....	70
4.2.3	Uji Asumsi Klasik.....	73
4.2.4	Uji Hipotesis.....	77
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian.....	80
4.3.1	Pengaruh <i>Investor Sentiment</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	80
4.3.2	Pengaruh <i>Relative Strength Index (RSI)</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	82
4.3.3	Pengaruh <i>Analyst Recommendation</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	84
4.3.4	Pengaruh <i>Net Foreign Flow (NFF)</i> terhadap <i>Return Saham</i> .....	85
BAB V PENUTUP.....		88
5.1	Kesimpulan.....	88
5.2	Keterbatasan .....	90

5.3	Saran.....	92
DAFTAR PUSTAKA .....		93
LAMPIRAN.....		96

