

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	10
1.3.1 Tujuan Penelitian	10
1.3.2 Manfaat Penelitian	11
1.4 Sistematika Penulisan	11
BAB II TELAAH PUSTAKA	13
2.1 Definisi-definisi	13
2.1.1 Pasar Modal.....	13
2.1.2 Investasi	14
2.1.3 Pengembalian saham (<i>Stock Return</i>).....	18
2.1.4 Likuiditas	19
2.1.5 Risiko Likuiditas (illikuiditas)	22
2.1.6 Ukuran Perusahaan	23
2.1.7 Beta	24
2.1.8 Total Risiko.....	25

2.1.9	<i>Tick Price</i>	27
2.1.10	<i>Dividend Yield</i>	28
2.1.11	R100 dan R100RY	28
2.2	Landasan Teori	29
2.2.1	Rasio illikuiditas Amihud	29
2.3	Hubungan Antar Variabel.....	32
2.3.1	Hubungan antara Risiko Likuiditas (<i>ILLIQMA</i>) dengan <i>Stock Returns</i>	32
2.3.2	Hubungan antara Risiko Likuiditas (<i>ILLIQBA</i>) dengan <i>Stock Returns</i>	33
2.3.3	Hubungan antara Ukuran Perusahaan dengan <i>Stock Returns</i>	34
2.3.4	Hubungan antara <i>Beta</i> dengan <i>Stock Returns</i>	36
2.3.5	Hubungan antara Total Risiko dengan <i>Stock Returns</i>	37
2.3.6	Hubungan antara <i>Tick Price</i> dengan <i>Stock Returns</i>	38
2.3.7	Hubungan antara <i>Dividend Yield</i> dengan <i>Stock Returns</i>	39
2.3.8	Hubungan antara R100 dan R100YR dengan <i>Stock Returns</i>	40
2.4	Penelitian Terdahulu	41
2.5	Kerangka Pemikiran Teoritis	50
2.6	Hipotesis	51
BAB III	METODE PENELITIAN	53
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	53
3.1.1	Variabel Penelitian	53
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	54
3.1.2.1	<i>Dependent Variable</i>	54
3.1.2.2	<i>Independent Variable</i>	54
3.2	Populasi dan Sampel.....	59
3.3	Jenis dan Sumber Data.....	60
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	61
3.5	Metode Analisis	61

3.5.1 Analisis Regresi Berganda	61
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	62
3.5.2.1 Uji Normalitas	63
3.5.2.2 Uji Multikolinieritas	63
3.5.2.3 Uji Heteroskedastisitas	64
3.5.2.4 Uji Autokolerasi.....	65
3.5.3 Uji Hipotesis	66
3.5.3.1 Uji F-statistik	66
3.5.3.2 Uji Koefisien determinasi (R^2)	67
3.5.3.3 Uji T-statistik	68
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	69
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	69
4.2 Analisis Data.....	70
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif	70
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	74
4.2.3 Analisis Regresi Berganda	78
4.2.4 Pengujian Hipotesis.....	80
4.3 Pembahasan	87
4.3.1 Pengaruh Risiko Likuiditas (<i>ILLIQMA</i>) dengan <i>Stock Returns</i>	87
4.3.2 Pengaruh Risiko Likuiditas (<i>ILLIQBA</i>) dengan <i>Stock Returns</i>	88
4.3.3 Pengaruh Ukuran Perusahaan dengan <i>Stock Returns</i>	88
4.3.4 Pengaruh <i>Beta</i> dengan <i>Stock Returns</i>	89
4.3.5 Pengaruh Total Risiko dengan <i>Stock Returns</i>	90
4.3.6 Pengaruh <i>Tick Price</i> dengan <i>Stock Returns</i>	91
4.3.7 Pengaruh <i>Dividend Yield</i> dengan <i>Stock Returns</i>	92
4.3.8 Pengaruh R100 dengan <i>Stock Returns</i>	92
4.3.9 Pengaruh R100RY dengan <i>Stock Returns</i>	92
BAB V PENUTUP.....	94
5.1 Simpulan	94

5.2 Keterbatasan.....	97
5.3 Saran	97
DAFTAR PUSTAKA	99
LAMPIRAN	102