

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERSYARATAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRACT.....	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xvi
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	15
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	15
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	16
1.4 Sistematika Penulisan.....	16
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	18
2.1 Landasan Teori.....	18
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	19
2.1.2 Investor.....	19
2.1.3 Volatilitas Harga.....	19
2.1.4 Likuiditas.....	22

2.1.5 Earning per Share.....	23
2.1.6 Firm Size.....	24
2.1.7 Momentum.....	26
2.1.8 Return Saham.....	27
2.1.9 Landasan Teori.....	30
2.1.10 Pengaruh Variabel Dependen terhadap variabel Indepenen	32
2.1.10.1 Pengaruh Volatilitas Harga terhadap Return Saham	32
2.1.10.2 Pengaruh EPS terhadap Return Saham.....	33
2.1.10.3 Pengaruh Likuiditas terhadap Return Saham.....	33
2.1.10.4 Pengaruh Size Firm terhadap Return Saham.....	34
2.1.10.5 Pengaruh Momentum terhadap Return Saham.....	35
2.2 Penelitian Terdahulu.....	36
2.3 Kerangka Pemikiran.....	40
2.4 Perumusan Hipotesis.....	40
BAB III METODE PENELITIAN.....	43
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	43
3.1.1 Variabel Penelitian.....	43
3.1.2. Definisi Operasional.....	43
3.1.2.1 Return Saham.....	44
3.1.2.2. Volatilitas Harga.....	44
3.1.2.3 Likuiditas Saham.....	45
3.1.2.4 EPS.....	46
3.1.2.5 <i>Size Firm</i>	46
3.1.2.6 Momentum Overnight.....	46
3.2 Jenis dan Sumber Data.....	50

3.3 Populasi dan Sampel.....	50
3.3.1 Populasi.....	50
3.3.2 Sampel.....	50
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	52
3.5 Metode Analisis Data.....	52
3.5.1 Metode Estimasi Model Analisis Regresi Panel.....	54
3.5.1.1 Metode Common Effect (POLS).....	54
3.5.1.2 Metode Fixed Effect (LSDV).....	55
3.5.1.3 Metode Random Effect.....	56
3.5.2 Uji Signifikansi Model.....	58
3.5.2.1 Uji Statistik F (Common Effect vs Fixed Effect)...	58
3.5.2.2 Uji Hausman (Fixed Effect vs Random Effect).....	59
3.5.3 Uji Penyimpangan Asumsi Klasik.....	60
3.5.3.1 Uji Normalitas.....	61
3.5.3.2 Uji Multikolinearitas.....	63
3.5.3.3 Uji Autokorelasi.....	64
3.5.3.4 Uji Heteroskedastisitas.....	65
3.5.4 Menilai <i>Goodness of Fit</i> Suatu Model.....	66
3.5.4.1 Uji Signifikan Simultan (Uji Statistik F).....	66
3.5.4.2 Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	67
3.5.4 Uji Hipotesis.....	69
3.5.4.1 Uji t.....	69
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	71
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	71
4.1.1 Analisis Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	73

4.2 Analisis Data.....	76
4.2.1 Uji Pemilihan Model.....	76
4.2.1.1 Uji Statistik F.....	76
4.2.1.2 Uji Hausman.....	77
4.2.2 Uji Normalitas.....	78
4.2.3 Uji Penyimpangan Asumsi Klasik.....	80
4.2.3.1 Uji Multikolinieritas.....	80
4.2.3.2 Uji Heteroskedastisitas.....	81
4.2.3.3 Uji Autokolerasi.....	82
4.2.4 Uji Statistik.....	83
4.2.4.1 Uji Statistik t.....	84
4.2.4.2 Uji Statistik F.....	86
4.2.4.3 Uji Koefisien Determinasi (R^2) dan Adjusted R^2	87
4.3 Interpretasi Hasil.....	88
4.3.1 Pengaruh Volatilitas Harga terhadap Return Saham.....	88
4.3.2 Pengaruh EPS terhadap Return Saham.....	89
4.3.3 Pengaruh Likuiditas terhadap Return Saham.....	90
4.3.4 Pengaruh Size Firm terhadap Return Saham.....	91
4.3.5 Pengaruh Momentum terhadap Return Saham... ..	91
BAB V PENUTUP.....	95
5.1 Kesimpulan.....	95
5.2 Implikasi Penelitian.....	96
5.3 Keterbatasan.....	96
5.4 Agenda Penelitian yang Akan Datang.....	97
DAFTAR PUSTAKA.....	98

LAMPIRAN.....

102