

## DAFTAR ISI

|  |      |
|--|------|
| Halaman Judul.....                       | i    |
| Halaman Persetujuan Skripsi .....        | ii   |
| Halaman Pengesahan Kelulusan Ujian ..... | iii  |
| Pernyataan Orisinalitas Skripsi .....    | iv   |
| Motto.....                               | v    |
| <i>Abstract</i> .....                    | vi   |
| Abstrak .....                            | vii  |
| Kata Pengantar .....                     | viii |
| Daftar Tabel .....                       | xiv  |
| Daftar Gambar.....                       | xv   |
| Daftar Lampiran .....                    | xvi  |
| <b>BAB I PENDAHULUAN</b>                 |      |
| 1.1 Latar Belakang .....                 | 1    |
| 1.2 Rumusan Masalah .....                | 11   |
| 1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian ..... | 12   |
| 1.4 Sistematika Penulisan .....          | 14   |
| <b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b>           |      |
| 2.1 Definisi Konsep.....                 | 16   |
| 2.1.1 <i>Price Hit Limit</i> .....       | 16   |
| 2.1.1.1 <i>Price Limit</i> .....         | 16   |

|   |    |
|---|----|
| 2.1.1.2 Frekuensi Saham Mencapai Limit Harga.....                                       | 17 |
| 2.1.2 Beta .....  | 19 |
| 2.1.3 <i>Book to market Value</i> .....   | 22 |
| 2.1.4 <i>Firm Size</i> .....  | 25 |
| 2.1.5 Likuiditas .....  | 26 |
| 2.1.6 <i>Fama and French three factor model</i> .....                                   | 29 |
| 2.2 Pengaruh variable independen dengan variable dependennya.....                       | 30 |
| 2.2.1 pengaruh beta saham terhadap probabilitas <i>stock hit limit</i> .....            | 30 |
| 2.2.2 pengaruh <i>book to market</i> terhadap probabilitas <i>stock hit limit</i> ..... | 30 |
| 2.2.3 pengaruh <i>firm size</i> terhadap probabilitas <i>stock hit limit</i> .....      | 32 |
| 2.2.4 pengaruh likuiditas terhadap probabilitas <i>stock hit limit</i> .....            | 33 |
| 2.3 Penelitian Terdahulu .....  | 34 |
| 2.4 Kerangka Pemikiran.....   | 36 |
| 2.4 Hipotesis.....  | 38 |

### **BAB III METODE PENELITIAN**

|   |    |
|---|----|
| 3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel ..... | 40 |
| 3.1.1 Variabel Dependen.....                                    | 40 |
| 3.1.2 Variabel Independen .....                                 | 41 |
| 3.2 Populasi dan Sampel .....                                   | 45 |
| 3.3 Jenis dan Sumber Data .....                                 | 46 |
| 3.4 Metode Pengumpulan Data .....                               | 47 |
| 3.5 Metode Analisis Data.....                                   | 47 |

|  |    |
|--|----|
| 3.5.1 Statistik Deskriptif .....                                     | 48 |
| 3.5.2 Pengujian Hipotesis Penelitian.....                            | 48 |
| 3.5.2.1 Menilai Keseluruhan Model ( <i>Overall Model Fit</i> ) ..... | 49 |
| 3.5.2.2 Koefisien Determinasi ( <i>Nagelkerke R Square</i> ).....    | 49 |
| 3.5.2.3 Menguji Kelayakan Model Regresi .....                        | 50 |
| 3.5.2.4 Uji Multikolinieritas.....                                   | 50 |
| 3.5.2.5 Matriks Klasifikasi.....                                     | 51 |
| 3.5.2.6 Model Regresi Logistik yang Terbentuk .....                  | 51 |

#### **BAB IV HASIL DAN ANALISIS**

|   |    |
|---|----|
| 4.1 Gambaran Singkat Objek Penelitian .....       | 52 |
| 4.2 Statistika Deskriptif.....                    | 55 |
| 4.3 Hasil Analisis Data <i>Up Hit</i> .....       | 57 |
| 4.3.1 Menilai Keseluruhan Model.....              | 57 |
| 4.3.2 Koefisien Determinasi.....                  | 58 |
| 4.3.3 Menguji Kelayakan Model Regresi .....       | 58 |
| 4.3.4 Uji Multikolinieritas.....                  | 59 |
| 4.3.5 Matriks Klasifikasi .....                   | 59 |
| 4.3.6 Model Regresi Logistik yang Terbentuk ..... | 60 |
| 4.3.7 Pembahasan.....                             | 61 |
| 4.4 Hasil Analisis Data <i>Down Hit</i> .....     | 61 |
| 4.4.1 Menilai Keseluruhan Model.....              | 61 |
| 4.4.2 Koefisien Determinasi.....                  | 62 |

|   |           |
|---|-----------|
| 4.4.3 Menguji Kelayakan Model Regresi .....       | 63        |
| 4.4.4 Uji Multikolinieritas.....                  | 63        |
| 4.4.5 Matriks Klasifikasi .....                   | 64        |
| 4.4.6 Model Regresi Logistik yang Terbentuk ..... | 65        |
| 4.4.7 Pembahasan.....                             | 65        |
| 4.5 Interpretasi Hasil .....                      | 66        |
| <b>BAB V PENUTUP</b>                              |           |
| 5.1 Kesimpulan .....                              | 69        |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian.....                  | 70        |
| 5.3 Saran.....                                    | 70        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>                       | <b>71</b> |
| <b>LAMPIRAN</b>                                   |           |