

**ANALISIS PENGARUH *BOOK TO MARKET*,
SIZE, *SYSTEMATIC RISK*, DAN *MOMENTUM*
TERHADAP *RETURN SAHAM*
SMALL BUT LIQUID DAN *BIG BUT ILLIQUID***

(Studi pada Perusahaan yang terdaftar di Kompas100

Tahun 2011-2015)



SKRIPSI

Diajukan sebagai salah satu syarat
untuk menyelesaikan Program Sarjana (S1)
pada Program Sarjana Fakultas Ekonomi
Universitas Diponegoro

Disusun oleh:

FIRDA HUWAIDA ULFAH

NIM. 12010113140192

**FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS
UNIVERSITAS DIPONEGORO
SEMARANG**

2017