

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	i
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
ABSTRACT.....	iv
ABSTRAK.....	v
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	9
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	9
1.3.2 Manfaat Penelitian.....	9
1.4 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	12
2.1 Landasan Teoritis.....	12
2.1.1 Pasar Modal.....	12
2.1.2 <i>Rational Expectations Theory</i>	13
2.1.3 KOMPAS100.....	19
2.2 Kajian Variabel Penelitian.....	20
2.2.1 Anomali Pasar.....	20
2.2.2 <i>Firm Size</i>	26
2.2.3 <i>Return on Asset (ROA)</i>	29

2.2.4	<i>Return on Equity (ROE)</i>	31
2.2.5	<i>Debt to Equity Ratio (DER)</i>	32
2.2.6	<i>Price Earning Ratio (PER)</i>	34
2.2.7	<i>Stock Return</i>	34
2.3	Penelitian Terdahulu.....	36
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	40
2.5	Hipotesis Pemikiran.....	41
2.5.1	Pengaruh January Effect Terhadap Stock Return.....	41
2.5.2	Pengaruh <i>Firm Size</i> Terhadap <i>Stock Return</i>	43
2.5.3	Pengaruh <i>Return on Asset (ROA)</i> Terhadap <i>Stock Return</i>	44
2.5.4	Pengaruh <i>Return on Equity (ROE)</i> terhadap <i>Stock Return</i>	44
2.5.5	Pengaruh Debt to Equity Ratio (DER) terhadap Stock Return.....	45
2.5.6	Pengaruh <i>Price Earning Ratio (PER)</i> terhadap <i>Stock Return</i>	46
BAB III METODE PENELITIAN.....		47
3.1	Jenis Penelitian.....	47
3.2	Sumber Data.....	47
3.3	Populasi Dan Sampel.....	47
3.3.1	Populasi.....	47
3.3.2	Sampel.....	48
3.4	Definisi Operasional.....	48
3.4.1	Variabel Independen.....	49
3.4.2	Variabel Dependen.....	56
3.5	METODE DAN ALAT ANALISIS.....	57
3.5.1	Metode Pengumpulan Data.....	57
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	57
3.5.3	Uji Statistik Deskriptif.....	60
3.5.4	Uji Regresi Linear Berganda.....	60
3.5.5	Uji Dummy.....	61
3.5.6	Pengujian Hipotesis.....	62
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		64

4.1	Deskripsi Objek Penelitian	64
4.2	Analisis Data	65
4.2.1	Uji Statistik Deskriptif	65
4.2.2	Analisis Uji Asumsi Klasik.....	69
4.2.3	Hasil Uji Hipotesis	81
4.3	Interpretasi Hasil	86
4.3.1	<i>January Effect</i> Berpengaruh Positif Terhadap <i>Stock Return</i>	88
4.3.2	<i>Firm Size</i> Berpengaruh Positif Terhadap <i>Stock Return</i>	90
4.3.3	Pengaruh ROA Terhadap <i>Stock Return</i>	90
4.3.4	Pengaruh ROE Terhadap <i>Stock Return</i>	91
4.3.5	Pengaruh DER Terhadap <i>Stock Return</i>	92
4.3.6	Pengaruh PER Terhadap <i>Stock Return</i>	93
BAB V PENUTUP		95
5.1	Kesimpulan.....	95
5.2	Keterbatasan	97
5.3	Saran.....	98
DAFTAR PUSTAKA		100
LAMPIRAN.....		104
	Lampiran A Daftar Nama Perusahaan Sampel Penelitian.....	104
	Lampiran B Tabulasi Data Sekunder	106
	Lampiran C Hasil Output SPSS	114

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	36
Tabel 3.1 Deskripsi Variabel.....	49
Tabel 3.2 Durbin Watson	59
Tabel 4.1 Sampel Penelitian	65
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif	66
Tabel 4.3 Uji Kolmogorov-Smirnov Sebelum <i>Outlier</i>	72
Tabel 4.4 Uji Kolmogorov-Smirnov Setelah <i>Outlier</i>	75
Tabel 4.5 Uji Multikolinearitas.....	79
Tabel 4.6 Uji Multikolinearitas: <i>Condition Index</i>.....	79
Tabel 4.7 Uji Autokorelasi	80
Tabel 4.8 Tabel Bantu Distribusi DW.....	80
Tabel 4.9 Uji F Statistik.....	81
Tabel 4.10 Uji T Statistik.....	82
Tabel 4.11 Uji Koefisien Determinasi	86
Tabel 4.12 Rangkuman Hasil Uji Hipotesis.....	87

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	40
Gambar 4.1 Uji Normalitas <i>Stock Return</i>	70
Gambar 4.2 Uji Normalitas <i>Stock Return</i> Sebelum <i>Outlier</i>	71
Gambar 4.3 Uji Normalitas <i>Stock Return</i> Setelah <i>Outlier</i>	74
Gambar 4.4 Uji Normalitas <i>Stock Return</i> Setelah <i>Outlier</i>	75
Gambar 4.5 Uji Heterokedastisitas	77