

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
ABSTRACT.....	xvi
ABSTRAKSI.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Perumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6

1.4	Kontribusi Dan Manfaat Penelitian.....	7
BAB II	KAJIAN PUSTAKA.....	9
2.1.	Landasan Teori.....	9
2.1.1.	Teori Portofolio.....	9
2.1.2.	Teori Signaling.....	10
2.2.	Definisi Variabel	11
2.2.1.	Pasar Modal	11
2.2.2.	<i>Return</i> Saham.....	13
2.2.3.	Risiko Sistematis.....	15
2.2.4.	Beta (β)	16
2.2.5.	Saham.....	17
2.2.6.	Likuiditas Saham	18
2.2.7.	<i>Leverage</i>	19
2.3.	Penelitian Terdahulu	21
2.4.	Hipotesis.....	26
2.4.1.	Pengaruh Risiko Sistematis Terhadap Return Saham	26

2.4.2.	Pengaruh Likuiditas Saham Terhadap <i>Return</i> Saham	27
2.4.3.	Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap <i>Return</i> Saham	28
2.5.	Kerangka Pemikiran Teoritis	30
BAB III METODE PENELITIAN		32
3.1.	Jenis Penelitian.....	32
3.2.	Variabel Dan Definisi Operasional Variabel	32
3.2.1.	Variabel Penelitian.....	32
3.2.2.	Definisi Operasional Variabel.....	33
3.2.3.	Operasional Variabel	33
3.3.	Populasi Dan Sampel	35
3.4.	Jenis Data Dan Sumber Data	35
3.5.	Teknik Sampling	36
3.6.	Teknik Pengumpulan Data.....	36
3.7.	Teknik Analisis	36
3.7.1.	Analisis Deskriptif	37
3.7.2.	Uji Asumsi Klasik.....	37
3.7.3.	Uji Regresi Linier Berganda	39

3.7.4.	Pengujian Hipotesis	40
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		41
4.1.	Hasil Penelitian	41
4.1.1.	Deskripsi Sampel	41
4.1.2.	Statistic Deskriptif	42
4.2.	Analisis Data	43
4.2.1.	Pengujian Asumsi Klasik.....	43
4.2.1.1.	Uji Normalitas Data.....	44
4.2.1.2.	Uji Autokorelasi	46
4.2.1.3.	Uji Multikoloniaritas	48
4.2.1.4.	Uji Heterokedastisitas.....	49
4.2.2.	Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistic F)	50
4.2.3.	Koefisien Determinasi	51
4.2.4.	Analisis Regresi Linier Berganda	52
4.2.5.	Pengujian Hipotesis(Uji t).....	53
4.2.5.1.	Pengujian Hipotesis 1	54
4.2.5.2.	Pengujian Hipotesis 2	55

4.2.5.3. Pengujian Hipotesis 3	55
4.3. Pembahasan.....	55
4.3.1. Pengaruh Risiko Sistematis Terhadap <i>Return</i> Saham	55
4.3.2. Likuiditas Saham Terhadap <i>Return</i> Saham.....	56
4.3.3. Pengaruh <i>Leverage</i> Terhadap <i>Return</i> Saham.....	57
BAB V PENUTUP	59
5.1. Kesimpulan	59
5.2. Saran.....	59
5.3. Keterbatasan Penelitian	60
5.4. Usulan Penelitian Selanjutnya.....	60
DAFTAR PUSTAKA	62
LAMPIRAN	65