

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
BERITA ACARA UJIAN SKRIPSI.....	iv
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	v
MOTTO.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	viii
ABSTRAK.....	x
<i>ABSTRACT</i>	xi
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xvi
DAFTAR GAMBAR.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	7
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4. Tujuan Penelitian.....	8
1.5. Batasan Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Sistematika Pembahasan.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11

2.1 Tinjauan Teori.....	11
2.1.1. Teori Signal.....	11
2.1.2. <i>Behavior Finance</i>	13
2.1.3. Return Saham.....	14
2.1.4. Profitabilitas.....	16
2.1.5. Likuiditas.....	18
2.1.6. <i>Leverage</i>	20
2.1.7. Sentimen Investor.....	21
2.2 Tinjauan Penelitian Terdahulu.....	23
2.3 Kerangka Konseptual.....	26
2.4 Hipotesis penelitian.....	27
2.4.1 Pengaruh Profitabilitas terhadap Return Saham.....	27
2.4.2 Pengaruh Likuiditas terhadap Return Saham.....	28
2.4.3 Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Return Saham.....	29
2.4.4 Pengaruh Sentimen Investor terhadap Return Saham.....	30
BAB III METODE PENELITIAN.....	31
3.1 Rancangan Penelitian.....	31
3.2 Populasi.....	31
3.3 Sampel dan Metode Pemilihan Sampel.....	32
3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	34
3.4.1 Variabel Penelitian.....	34
3.4.2 Definisi Operasional.....	34
3.4.2.1 Profitabilitas.....	34

3.4.2.2 Likuiditas.....	35
3.4.2.3 <i>Leverage</i>	36
3.4.2.4 Sentimen Investor.....	37
3.4.2.5 Return Saham.....	37
3.5 Prosedur Pengambilan Data.....	38
3.6 Model dan Teknik Analisis Data.....	38
3.6.1 Statistik Deskriptif.....	38
3.6.2 Uji Normalitas.....	38
3.6.3 Uji Asumsi Klasik.....	40
3.6.3.1 Uji Multikolonieritas.....	40
3.6.3.2 Uji Autokorelasi.....	41
3.6.3.3 Uji Heterokedastisitas.....	41
3.6.4 Analisis Regresi Linear Berganda.....	42
3.6.5 Uji Hipotesis.....	43
3.6.5.1 Uji Koefisien Determinasi.....	43
3.6.5.2 Uji Simultan (Uji Statistik F).....	43
3.6.5.3 Uji Parsial (Uji Statistik T).....	44
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
4.1 Deskripsi Data.....	45
4.1.1 Data Penelitian.....	45
4.2 Analisis dan Hasil Penelitian.....	46
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	46
4.2.2 Uji Normalitas.....	55

4.2.3 Uji Asumsi Klasik.....	56
4.2.3.1 Uji Multikolonieritas.....	57
4.2.3.2 Uji Autokorelasi.....	58
4.2.3.3 Uji Heterokedastisitas.....	59
4.2.4 Analisis Regresi Linear Berganda.....	60
4.2.5 Uji Hipotesis.....	63
4.2.5.1 Koefisien Determinasi.....	63
4.2.5.2 Uji Simultan (Uji Statistik F).....	64
4.2.5.3 Uji Parsial (Uji Statistik T).....	65
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	67
4.3.1 Pengaruh Profitabilitas terhadap Return Saham.....	67
4.3.2 Pengaruh Likuiditas terhadap Return Saham.....	68
4.3.3 Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Return Saham.....	69
4.3.4 Pengaruh Sentimen Investor terhadap Return Saham.....	70
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	72
5.1 Kesimpulan.....	72
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	73
5.3 Saran.....	74
DAFTAR PUSTAKA.....	75
LAMPIRAN.....	80

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Tinjauan Penelitian Terdahulu.....	23
Tabel 3.1 Daftar Perusahaan Sampel.....	32
Tabel 4.1 Ringkasan Prosedur Pemilihan Sampel.....	46
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	47
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas.....	50
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas.....	52
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi.....	53
Tabel 4.6 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	54
Tabel 4.7 Hasil Uji Regresi Linear Berganda.....	55
Tabel 4.8 Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	57
Tabel 4.9 Hasil Uji Simultan F.....	58
Tabel 4.10 Hasil Uji Parsial T.....	59

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual.....	26
-------------------------------------	----