

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR.....	viii
<i>ABSTRACT</i>	ix
ABSTRAK	x
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	14
1.3 Tujuan Penelitian.....	15
1.4 Kegunaan Penelitian.....	16
1.5 Sistematika Penulisan.....	17
BAB II TELAAH PUSTAKA.....	19
2.1 Landasan Teori	19
2.1.1 Teori <i>Signaling</i>	19
2.1.2 Likuiditas	21
2.1.3 Informasi Keuangan.....	21
2.1.4 Informasi Pasar	22
2.1.5 Dividen	23
2.1.6 <i>Capital Gain</i>	23
2.2 Penelitian Terdahulu	24
2.3 Kerangka Pemikiran	40
2.4 Perumusan Hipotesis	41
2.4.1 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap <i>Returns</i> Saham	41
2.4.2 Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	42

2.4.3 Pengaruh Pertumbuhan Aset Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	43
2.4.4 Pengaruh <i>Return on Asset</i> Terhadap <i>Returns</i> Saham.....	44
2.4.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> Terhadap <i>Returns</i> Saham	46
BAB III METODE PENELITIAN.....	48
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	48
3.1.1 Variabel Dependen.....	48
3.1.2 Variabel Independen	49
3.1.2.1 Volume Perdagangan.....	49
3.1.2.2 Kapitalisasi Pasar	50
3.1.2.3 Pertumbuhan Aset	51
3.1.2.4 ROA	52
3.1.2.5 PBV.....	53
3.2 Populasi dan Sampel	56
3.2.1 Populasi.....	56
3.2.2 Sampel	57
3.3 Jenis dan Sumber Data	58
3.4 Metode Pengumpulan Data	58
3.5 Metode Analisis.....	59
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	59
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	60
3.5.3 Analisis Regresi Linear Berganda.....	63
3.5.4 Uji F (Simultan).....	64
3.5.5 Uji t (Parsial).....	65
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	66
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	66
4.2 Analisis Data.....	68
4.2.1 Hasil Analisis Statistik Deskriptif.....	68
4.2.2 Hasil Uji Asumsi Klasik	73
4.2.2.1 Hasil Uji Normalitas Residual	74
4.2.2.2 Hasil Uji Multikolinearitas.....	75
4.2.2.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas	75
4.2.2.4 Hasil Uji Autokorelasi.....	76

4.2.3 Hasil Uji Hipotesis.....	77
4.2.3.1 Hasil Analisis Regresi Linear Berganda	78
4.2.3.2 Hasil Uji Koefisien Determinasi	80
4.2.3.3 Hasil Uji Statistik F	81
4.2.3.4 Hasil Uji Statistik t.....	82
4.3 Interpretasi Hasil	84
4.3.1 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap <i>Returns Saham</i>	85
4.3.2 Pengaruh Kapitalisasi Pasar terhadap <i>Returns Saham</i>	86
4.3.3 Pengaruh Pertumbuhan Aset terhadap <i>Returns Saham</i>	87
4.3.4 Pengaruh <i>Returns on Asset</i> terhadap <i>Returns Saham</i>	88
4.3.5 Pengaruh <i>Price to Book Value</i> terhadap <i>Returns Saham</i>	90
BAB V KESIMPULAN.....	92
5.1 Simpulan.....	92
5.2 Keterbatasan	94
5.3 Saran.....	95
DAFTAR PUSTAKA.....	97
LAMPIRAN.....	103

