

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRACT.....	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	8
1.4 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Definisi.....	9
2.1.1 Investor Sentiment Theory.....	9
2.1.2 Momentum.....	10
2.1.3 Rekomendasi Analis.....	10
2.1.4 Order Imbalance.....	12
2.1.5 Trading Volume Activity.....	13
2.1.6 Return Saham.....	14
2.2 Penelitian Terdahulu.....	15
2.3 Perbedaan Penelitian.....	19
2.4 Pengaruh Antar Variabel.....	21
2.4.1 Pengaruh Rekomendasi Analis Saham terhadap Return Saham.....	21
2.4.2 Pengaruh <i>Order Imbalance</i> terhadap Return Saham.....	22
2.4.3 Pengaruh Trading Volume Activity terhadap Return Saham.....	22
2.4.4 Pengaruh Momentum terhadap Return Saham.....	23
2.5 Kerangka Pemikiran.....	24
2.6 Perumusan Hipotesis.....	25

BAB III METODE PENELITIAN.....	29
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	29
3.1.1 Variabel Penelitian.....	29
3.1.2 Definisi Operasional.....	29
3.2 Populasi dan Sampel.....	34
3.2.1 Populasi	34
3.2.2 Sampel	34
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	36
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	37
3.5 Metode Analisis	37
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	38
3.5.2 Uji Asumsi Klasik	39
3.5.3 Uji Hipotesis	43
BAB IV HASIL DAN ANALISIS DATA	47
4.1 Gambaran Umum dan Statistik Deskriptif	47
4.1.1 Gambaran Umum dan Objek Penelitian.....	47
4.1.2 Statistik Deskriptif.....	48
4.2 Analisis Data.....	52
4.2.1 Uji Asumsi Klasik	52
4.2.2 Uji Hipotesis	57
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	62
4.3.1 Pengaruh Rekomendasi Analis (ANR) Terhadap Return Saham	63
4.3.2 Pengaruh <i>Order Imbalance</i> (OI) Terhadap Return Saham (Return) ..	64
4.3.3 Pengaruh Trading Volume Activity (ANR) Terhadap Return Saham.	65
4.3.4 Pengaruh Momentum (MOMENTUM) Terhadap Return Saham.....	65
BAB V PENUTUP.....	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Keterbatasan	68
5.3 Saran	69
DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN.....	77