

## DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR .....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
INTISARI .....	x
<i>ABSTRACT</i> .....	xi
PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	6
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	8
1.4 Tujuan Penelitian .....	8
1.5 Manfaat Penelitian .....	8
1.6 Lingkup Penelitian .....	9
1.7 Sistematika Penulisan .....	9
LANDASAN TEORI.....	10
2.1 Landasan Teori.....	10
2.1.1 Teori Portofolio.....	10
2.1.2 <i>Asset Pricing</i> .....	11
2.1.3 <i>Liquidity</i> .....	14
2.1.4 <i>Free Float Stock</i> .....	17
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu.....	19
2.3 Perumusan Hipotesis.....	21
METODE PENELITIAN.....	27
3.1 Metode Pengumpulan Data .....	27
3.2 Populasi dan Sampel .....	28
3.3 Instrumen Penelitian .....	29
3.4 Variabel Penelitian.....	31
3.4.1 Variabel Independen .....	31

3.4.2 Variabel Dependen.....	33
3.5 Metode Analisis Data.....	34
3.5.1 Pembuatan Portofolio.....	34
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	35
3.5.3 Uji Hipotesis .....	37
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....	39
4.1 Deskripsi Data.....	39
4.2 Statistik Deskriptif .....	39
4.3 Uji Asumsi Klasik.....	43
4.3.1 Uji Normalitas .....	43
4.3.2 Uji Multikolinieritas .....	44
4.3.3 Uji Autokorelasi.....	44
4.3.4 Uji Heteroskedastisitas .....	45
4.4 Hasil Pengujian Regresi .....	45
4.4.1 Hasil Regresi Portofolio Size-B/M.....	46
4.4.2 Hasil Regresi Portofolio Size-OP .....	48
4.4.3 Hasil Regresi Portofolio Size-Inv .....	50
4.4.4 Hasil Regresi Portofolio Size-LIQ.....	52
4.4.5 Hasil Regresi Portofolio Size-FF.....	54
4.5 Uji Model (F) .....	56
KESIMPULAN DAN SARAN.....	58
5.1 Kesimpulan .....	58
5.2 Implikasi .....	60
5.3 Saran .....	60
DAFTAR PUSTAKA .....	62
LAMPIRAN 1 .....	65
LAMPIRAN 2 .....	67
LAMPIRAN 3 .....	77
LAMPIRAN 4.....	87