

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori.....	11
2.1.1 Teori yang relevan:	11
2.1.2 Variabel-variabel penelitian:	14
2.2 Penelitian yang Relevan	18
2.3 Rumusan Hipotesis.....	25
2.4 Paradigma Penelitian	27
BAB III METODE PENELITIAN	28
3.1 Desain Penelitian.....	28
3.2 Jenis dan Sumber Data	28
3.3 Teknik Pengumpulan Data.....	29
3.4 Populasi dan Sampel Penelitian	29
3.5 Identifikasi dan Definisi Operasi Variabel	31
3.5.1 Identifikasi Variabel	31
3.5.2 Definisi operasional Variabel.....	31

3.6 Teknik Analisis Data	33
3.6.1 Analisis Statistik Deskriptif	33
3.6.2 Uji Korelasi	33
3.6.3 Metode Estimasi Data Panel	34
3.6.4 Uji Asumsi Klasik	37
3.7 Uji Hipotesis	39
3.7.1 Analisis Regresi Data Panel	39
3.7.2 Uji Signifikansi Parameter (Uji T)	40
3.7.3 Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	40
3.7.4 Koefisien Determinasi (R^2)	41
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	43
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	43
4.2 Hasil Analisis Data	45
4.2.1 Laporan Statistik Deskriptif	45
4.2.2 Hasil Uji Korelasi	47
4.2.3 Hasil Model Regresi Data Panel	50
4.2.4 Hasil Uji Signifikansi Model Regresi Data Panel	53
4.2.5 Hasil Uji Asumsi Klasik	55
4.3 Hasil Uji Hipotesis	58
4.3.1. Hasil Uji Regresi Data Panel	59
4.3.2. Hasil Uji T	61
4.3.3 Hasil Uji F	62
4.3.4 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	62
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian	63
4.4.1 Pengaruh <i>Momentum Overnight</i> terhadap <i>Return Saham</i>	63
4.4.2 Pengaruh Volatilitas Harga Saham terhadap <i>Return Saham</i>	64
4.4.3 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap <i>Return Saham</i>	65
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	66
5.1 Kesimpulan	66
5.2 Saran	67
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	72