

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	xiii
INTISARI	xiv
<i>ABSTRACT</i>	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.6 Lingkup Penelitian	6
1.7 Sistematika Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 <i>Agency Theory</i>	9
2.1.2 <i>Signaling Theory</i>	9
2.1.3 Likuiditas.....	10
2.1.4 Volatilitas <i>Return Saham</i>	10
2.1.5 <i>Free Float</i>	10
2.1.6 Kinerja Perusahaan.....	11
2.1.7 Periode Perubahan Peraturan Pembobotan Indeks.....	11

2.2 Penelitian Terdahulu.....	11
2.3 Pengembangan Hipotesis.....	13
2.3.1 <i>Free Float</i> dan Likuiditas Saham.....	13
2.3.2 Kinerja Perusahaan dan Likuiditas Saham.....	14
2.3.3 <i>Free Float</i> dan Volatilitas <i>Return</i> Saham.....	15
2.3.4 Kinerja Perusahaan dan Volatilitas <i>Return</i> Saham.....	16
2.4 Kerangka Penelitian.....	17
BAB III METODE PENELITIAN	18
3.1 Desain Penelitian	18
3.2 Definisi Operasional	18
3.3 Metode Pengumpulan Data	20
3.4 Model Empiris	22
3.5 Metode Analisis Data	23
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	25
4.1 Statistik Deskriptif	25
4.1.1 Statistik Deskriptif Indeks KOMPAS100.....	25
4.1.2 Statistik Deskriptif Indeks PEFINDO25.....	26
4.1.3 Statistik Deskriptif Indeks Gabungan.....	27
4.2 Uji Multikolinearitas	28
4.2.1 Uji Multikolinearitas Indeks KOMPAS100 (ROE).....	28
4.2.2 Uji Multikolinearitas Indeks KOMPAS100 (NPM).....	29
4.2.3 Uji Multikolinearitas Indeks PEFINDO25 (ROE).....	29
4.2.4 Uji Multikolinearitas Indeks PEFINDO25 (NPM).....	30
4.2.5 Uji Multikolinearitas Indeks Gabungan (ROE).....	30
4.2.6 Uji Multikolinearitas Indeks Gabungan (NPM).....	31
4.3 Uji Heteroskedastisitas.....	31
4.3.1 Uji Heteroskedastisitas Indeks KOMPAS100 Likuiditas Saham (ROE).....	31

4.3.2 Uji Heteroskedastisitas Indeks KOMPAS100 Likuiditas Saham (NPM).....	32
4.3.3 Uji Heteroskedastisitas Indeks KOMPAS100 Volatilitas <i>Return</i> Saham (ROE).....	33
4.3.4 Uji Heteroskedastisitas Indeks KOMPAS100 Volatilitas <i>Return</i> Saham (NPM).....	33
4.3.5 Uji Heteroskedastisitas Indeks PEFINDO25 Likuiditas Saham (ROE).....	34
4.3.6 Uji Heteroskedastisitas Indeks PEFINDO25 Likuiditas Saham (NPM).....	34
4.3.7 Uji Heteroskedastisitas Indeks PEFINDO25 Volatilitas <i>Return</i> Saham (ROE).....	35
4.3.8 Uji Heteroskedastisitas Indeks PEFINDO25 Volatilitas <i>Return</i> Saham (NPM).....	36
4.3.9 Uji Heteroskedastisitas Indeks Gabungan Likuiditas Saham (ROE).....	36
4.3.10 Uji Heteroskedastisitas Indeks Gabungan Likuiditas Saham (NPM).....	37
4.3.11 Uji Heteroskedastisitas Indeks Gabungan Volatilitas <i>Return</i> Saham (ROE).....	38
4.3.12 Uji Heteroskedastisitas Indeks Gabungan Volatilitas <i>Return</i> Saham (NPM).....	38
4.4 Hasil Uji Hipotesis	39
4.4.1 Indeks KOMPAS100.....	39
4.4.1.1 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	39
4.4.1.2 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	42
4.4.1.3 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	45
4.4.1.4 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	48
4.4.2 Indeks PEFINDO25.....	51
4.4.2.1 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	51

4.4.2.2 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	53
4.4.2.3 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	57
4.4.2.4 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	59
4.4.3 Indeks Gabungan.....	63
4.4.3.1 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	63
4.4.3.2 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Likuiditas Saham</i>	66
4.4.3.3 <i>Free Float, Return on Equity (ROE), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	68
4.4.3.4 <i>Free Float, Net Profit Margin (NPM), Post, Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Return Saham</i>	72
4.5 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis.....	74
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	80
5.1 Simpulan	80
5.2 Saran	81
5.3 Implikasi	82
5.4 Keterbatasan.....	83
DAFTAR PUSTAKA	84
LAMPIRAN	86