

DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Judul.....	i
Lembar Pengesahan.....	ii
Lembar Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	ix
Daftar lampiran.....	x
Intisari.....	xi
Abstract.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Tujuan Penelitian.....	5
1.4. Manfaat Penelitian.....	6
1.4.1. Kontribusi Teoritis.....	6
1.4.2. Kontribusi Praktis.....	6
1.5. Sistematika Penulisan.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	9
2.1. <i>Return</i> Investasi.....	9

2.2. Pasar Efisien.....	10
2.3. Aset.....	11
2.4. Pertumbuhan Aset dan Return Saham di Periode Selanjutnya.....	12
2.5. Penelitian Terdahulu.....	17
2.6. Kerangka Pemikiran dan Pengembangan Hipotesis.....	27
2.6.1. Pertumbuhan Aset	27
2.6.2. Efek Pertumbuhan Aset terhadap <i>Return</i> Saham di Periode Selanjutnya.....	28
BAB III METODE PENELITIAN.....	31
3.1. Data.....	31
3.2. Seleksi Sampel.....	31
3.3. Pemilihan Periode.....	33
3.4. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	33
3.4.1. Variabel Independen.....	33
3.4.2. Variabel Dependen.....	33
3.4.3. Variabel Kontrol.....	34
3.5. Model Empiris.....	35
3.5.1. Pengujian Hipotesis	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	38
4.1. Statistika Deskriptif.....	38
4.2. Hasil dan Pembahasan Hipotesis.....	39
4.2.1. Penentuan Model dan Uji Asumsi Klasik.....	39
4.2.2. Hasil Pengujian Hipotesis.....	42

4.3. Perbandingan dengan Penelitian Terdahulu.....	43
4.4. Penyebab Efek Pertumbuhan Aset Tidak Terjadi di BEI.....	44
BAB V SIMPULAN.....	50
5.1. Simpulan.....	50
5.2. Implikasi.....	51
5.3. Keterbatasan Penelitian.....	51
5.4. Saran.....	52
Daftar Pustaka.....	53
Lampiran.....	55

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Pasar Saham Asia Pasifik dengan kinerja terbaik di 2016.....	1
Tabel 2.1 Komponen-komponen di dalam Neraca.....	12
Tabel 3.1. Variabel Independen Penelitian.....	32
Tabel 3.2. Variabel Dependen Penelitian	33
Tabel 3.3. Variabel Kontrol Penelitian	34
Tabel 3.4. Variabel Kontrol Penelitian	34
Tabel 4.1. Tabel Statistik Deskriptif.....	38
Tabel 4.2. Hasil Hausman <i>Test</i>	39
Tabel 4.3. Hasil Multicollinearity <i>Test</i>	40
Tabel 4.4. Hasil pengujian Regresi <i>Random Effect</i>	41
Tabel 4.5. Hasil Pengujian Regresi Random Effect kelompok DA Tinggi...	45
Tabel 4.6. Hasil Pengujian Regresi Random Effect kelompok DA Rendah...	46
Tabel 4.7. Rentang Periode Penelitian-Penelitian Terkait Efek Pertumbuhan Aset.....	48

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1: Sampel Penelitian.....	54
Lampiran 2: Hasil Uji Hausman pada Keseluruhan Observasi	60
Lampiran 3: Hasil Uji <i>Multicollinearity</i> pada Keseluruhan Observasi.....	60
Lampiran 4: Hasil Uji Hipotesis pada Keseluruhan Observasi.....	61
Lampiran 5: Hasil Uji Regresi Random Effect pada Kelompok DA Tinggi..	61
Lampiran 6: Hasil Uji Regresi Random Effect pada Kelompok DA Rendah.	62