

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
I.1. Latar Belakang.....	1
I.2. Rumusan Masalah.....	3
I.3. Pertanyaan Penelitian.....	3
I.4. Tujuan Penelitian	4
I.5. Manfaat Penelitian	4
I.6. Lingkup Penelitian.....	5
I.7. Sistematika Penulisan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
II.1. Landasan Teori	8
II.2.1. Pasar Modal Indonesia	8
II.2.2. <i>Free Float Ratio</i> Saham dalam Pasar Modal	10
II.2.3. Likuiditas.....	14

II.2.4. <i>Firm Size</i>	20
II.2.5. <i>Return Saham</i>	21
II.2.6. <i>Earnings Per Share (EPS)</i> atau Laba Per Lembar Saham	22
II.2.7. <i>Price to Earnings Ratio (PER)</i>	23
II.2. Kajian Penelitian Terdahulu	24
II.3. Kerangka Pemikiran dan Pengembangan Hipotesis	25
BAB III METODA PENELITIAN	26
III.1. Desain Penelitian	26
III.2. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	27
3.2.1. Variabel Bebas	28
3.2.2. Variabel Terikat	28
3.2.3. Variabel Kontrol	29
III.3. Metode Pengolahan Data	29
III.4. Populasi dan Sampel.....	30
III.5. Instrumen Penelitian	31
III.6. Pengumpulan Data.....	32
III.7. Pengolahan Data	32
III.8. Pengujian Statistik	33
3.8.1. Uji Asumsi Klasik.....	33
3.8.2. Uji Regresi	35
3.8.3. Bentuk Model Regresi Data Panel	37
3.8.4. Uji Statistik t	41
3.8.5. Uji Statistik F	41

3.8.6. Koefisien Determinasi.....	42
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	44
IV.1. Statistik Deskriptif	44
IV.2. Uji Asumsi Klasik.....	45
IV.2.1. Uji Multikolinieritas	46
IV.2.2. Uji Heteroskedastisitas	46
IV.2.3. Uji Normalitas	47
IV.2.4. Uji Autokorelasi	48
IV.3. Hasil Pengolahan Data Panel	48
IV.3.1. Hasil Pengolahan Data Panel Pertama (LIQ1)	49
IV.3.2. Hasil Pengolahan Data Panel Kedua (LIQ2).....	51
IV.4. Pengujian Dan Pembahasan Hipotesis.....	54
IV.4.1. Uji Statistik t.....	54
IV.4.2. Uji F.....	56
IV.5. Uji Koefisien Determinasi (<i>Adjusted R Square</i>).....	57
BAB V SIMPULAN	59
V.1. Simpulan Penelitian	59
V.2. Implikasi Penelitian	59
V.3. Keterbatasan Penelitian.....	60
V.4. Saran	60

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Aktivitas Perdagangan Saham di BEI.....	10
Tabel 2.2	Ketentuan <i>Free Float</i> Bursa di Negara Lain.....	14
Tabel 4.1.	Statistik Deskriptif.....	44
Tabel 4.2	Hasil Uji Multikolinieritas.....	46
Tabel 4.3	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	46
Tabel 4.4	Nilai Durbin Watson Hasil Uji Autokorelasi.....	48
Tabel 4.5	Ringkasan Hasil Regresi Data.....	49
Tabel 4.6	Hasil Regresi Data Panel LIQ1 Model <i>Common Effect</i>	50
Tabel 4.7	Hasil Regresi Data Panel LIQ1 Model <i>Fixed Effect</i>	50
Tabel 4.8	Hasil Uji <i>Chow Test</i> LIQ1.....	50
Tabel 4.9	Hasil Regresi Data Panel LIQ1 Model <i>Random Effect</i>	51
Tabel 4.10	Hasil Uji <i>Hausman Test</i> LIQ1.....	51
Tabel 4.11	Hasil Regresi Data Panel LIQ2 Model <i>Common Effect</i>	52
Tabel 4.12	Hasil Regresi Data Panel LIQ2 Model <i>Fixed Effect</i>	52
Tabel 4.13	Hasil Uji <i>Chow Test</i> LIQ2.....	52
Tabel 4.14	Hasil Regresi Data Panel LIQ2 Model <i>Random Effect</i>	53
Tabel 4.15	Hasil Uji <i>Hausman Test</i> LIQ2.....	53
Tabel 4.16	Hasil Uji <i>Statistik F</i>	56
Tabel 4.17	Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Struktur Pasar Modal Indonesia.....	10
Gambar 3.1. Kerangka Pemikiran Penelitian.....	28

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.	Daftar Perusahaan Tercatat Sampel Penelitian.....	64
Lampiran 2.	Hasil Uji Asumsi Klasik.....	74
Lampiran 3.	Hasil Uji Regresi Data Panel Pertama.....	76
Lampiran 4.	Hasil Uji Regresi Data Panel Kedua.....	82
Lampiran 5.	Daftar Data Sampel Penelitian.....	88