

## DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN	
LEMBAR PENGESAHAN	
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	
SURAT PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT	
RIWAYAT HIDUP	
MOTTO	
ABSTRAK	
KATA PENGANTAR .....	i
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL.....	v
DAFTAR GAMBAR .....	vi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang .....	1
B. Identifikasi Masalah.....	13
C. Rumusan masalah.....	14
D. Tujuan penelitian.....	14
E. Manfaat Penelitian .....	15
F. Kerangka Pemikiran.....	16
G. Penelitian Terdahulu.....	20
H. Hipotesis Penelitian.....	25
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	26
A. Manajemen.....	26
1. Pengertian Manajemen .....	26
2. Fungsi-Fungsi Manajemen .....	29
3. Ayat tentang Manajemen .....	30
B. Manajemen Keuangan.....	33
1. Fungsi Manajemen Keuangan .....	34
2. Tujuan Manajemen Keuangan .....	35
3. Ayat tentang Manajemen Keuangan.....	36

C.	Pengertian Pasar Modal.....	39
1.	Pihak Yang Terlibat Di Pasar Modal.....	44
2.	Peran dan Manfaat Pasar Modal.....	49
3.	Investasi di Pasar Modal.....	51
D.	Saham sebagai pilihan investasi.....	51
E.	Pendekatan-pendekatan Analisis Dalam Penilaian Saham.....	52
F.	Return Saham Sebagai Proyeksi Atas Risiko.....	55
G.	Resiko Investasi.....	59
H.	Risiko Sistematis.....	64
I.	Likuiditas Saham.....	66
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....		70
A.	Metode Penelitian.....	70
B.	Populasi dan Sampel Penelitian.....	71
C.	Jenis Data.....	73
D.	Teknik Pengumpulan Data.....	73
E.	Variabel.....	73
F.	Operasionalisasi Variabel.....	75
G.	Teknik Analisis Data.....	76
H.	Teknik Estimasi Model Regresi Data Panel.....	80
I.	Metode Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	83
J.	Uji Hipotesis.....	84
K.	Jadwal Penelitian.....	86
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		88
A.	Gambaran Umum Objek Penelitian.....	88
B.	Hasil Penelitian.....	101
C.	Uji Pemilihan Model Regresi.....	102
1.	Pengujian menggunakan <i>Common Effect Model</i> .....	103
2.	Pengujian menggunakan <i>fixed effect model</i> .....	104
3.	Pengujian Menggunakan <i>Random Effect Model</i> .....	106
D.	Pemilihan Model Regresi.....	108
E.	Analisis Hasil Regresi Data Panel.....	111

F. Uji Hipotesis.....	113
1. Uji-t (Parsial) .....	114
2. Uji-f (Simultan).....	116
3. Koefisien determinasi ( $R^2$ ).....	117
G. Pembahasan Hasil Penelitian.....	118
1. Pengaruh Risiko pasar terhadap Return saham.....	118
2. Pengaruh Likuiditas Saham Terhadap Return Saham .....	120
3. Pengaruh Risiko Pasar dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham .	122
BAB V PENUTUP.....	127
A. Kesimpulan.....	127
B. SARAN.....	128
DAFTAR PUSTAKA .....	130

