

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	v
ABSTRAKSI.....	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian.....	6
D. Manfaat Penelitian	7
E. Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Pasar Modal.....	9

B. Pasar Modal Efisien	10
C. Teori Sinyal dan Asimetri Informasi	12
D. Bid-Ask Spread	13
E. Return Saham	15
F. Varian Return Saham.....	16
G. Volume Perdagangan	17
H. Penelitian Terdahulu	18
I. Pengembangan Hipotesis.....	19

BAB III METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	21
B. Populasi, Sampel Dan Teknik Pengambilan Data	21
C. Jenis Data dan Teknik Pengumpulan Data.....	22
D. Variabel Dan Definisi Operasional.....	22
1. Variabel Dependen.....	22
2. Variabel Independen	23
E. Teknik Analisis Data	25
1. Model Persamaan Regresi.....	25
2. Uji Asumsi Klasik	26
a. Uji Normalitas	26
b. Uji Multikolinieritas	27
c. Uji Autokorelasi.....	27
d. Uji Heteroskedastisitas	28

3. Pengujian Hipotesis	28
------------------------------	----

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Hasil Pengumpulan Data Penelitian	30
B. Statistik Deskriptif	30
C. Hasil Analisis Data	32
1. Uji Asumsi Klasik	32
a. Uji Normalitas	33
b. Uji Multikolinieritas	33
c. Uji Autokorelasi	34
d. Uji Heteroskedastisitas	35
2. Pengujian Hipotesis	36
3. Persamaan Regresi	37
D. Pembahasan Hasil Analisis	38

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan	41
B. Keterbatasan	41
C. Saran	42

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	18
Tabel 4.1 Hasil Kriteria Pemilihan Sampel.....	30
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif.....	31
Tabel 4.3 Uji Normalitas.....	33
Tabel 4.4 Uji Multikolinieritas	33
Tabel 4.5 Uji Autokorelasi	34
Tabel 4.6 Uji Heteroskedastisitas	35
Tabel 4.7 Tabel T-hitung.....	36

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama Perusahaan Sampel Penelitian
- Lampiran 2 Hasil Pengujian Statistik Deskriptif
- Lampiran 3 Hasil Pengujian Normalitas
- Lampiran 4 Hasil Pengujian Multikolinieritas
- Lampiran 5 Hasil Pengujian Autokorelasi
- Lampiran 6 Hasil Pengujian Heteroskedastisitas
- Lampiran 7 Hasil Pengujian Regresi Berganda
- Lampiran 8 Pengumpulan Data
- Lampiran 9 Hasil Perhitungan Data
- Lampiran 10 Kartu Bimbingan Skripsi Mahasiswa STIE MUSI