

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	v
ABSTRAKSI	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Perumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian	6
D. Manfaat Penelitian	7
E. Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Konsep Dasar Investasi	9
B. <i> Holding Period </i>	10
C. <i> Transaction Cost </i>	13
D. <i> Market Value </i>	15
E. <i> Risk of Stock </i>	16
F. Indeks LQ45	18
G. Penelitian Terdahulu	19
H. Kerangka Teoritis	23
I. Pengembangan Hipotesis	23

BAB III METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	27
B. Populasi dan Sampel	27
C. Jenis Data, Teknik Pengumpulan Data dan Sumber Data	28
D. Variabel dan Pengukurannya	29
E. Model Penelitian	32
F. Teknik Analisis Data	
1. Pengujian Asumsi Klasik	32
a. Uji Normalitas	33
b. Uji Heteroskedastisitas	33
c. Uji Autokorelasi	34
d. Uji Multikolinearitas	34
2. Uji Hipotesis	35

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Sampel Penelitian	36
B. Statistik Deskriptif	36
C. Pengujian Asumsi Klasik	39
D. Pengujian Hipotesis	43
E. Pembahasan Hasil Penelitian	46
F. Implikasi Penelitian	48

BAB V PENUTUP

A. Simpulan	51
B. Keterbatasan dan Saran	51

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Sampel Penelitian

Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif (sebelum memenuhi asumsi klasik)

Tabel 4.3 Hasil Statistik Deskriptif (setelah memenuhi asumsi klasik)

Tabel 4.4 Hasil *One Sample Kolmogorov Smirnov Test* (sebelum transformasi)

Tabel 4.5 Hasil *One Sample Kolmogorov Smirnov Test* (setelah transformasi)

Tabel 4.6 Hasil Uji Park (Uji Heteroskedastisitas)

Tabel 4.7 Hasil *Runs Test* (Uji Autokorelasi)

Tabel 4.8 Hasil Uji Multikolinearitas

Tabel 4.9 Hasil Uji Statistik

Tabel 4.10 Hasil Koefisien Determinasi

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Sampel Penelitian
- Lampiran 2 Data *Transaction Cost*, *Market Value*, dan *Risk of Stock* Sampel Penelitian Tahun 2009-2011
- Lampiran 3 Hasil Statistik Deskriptif (sebelum memenuhi asumsi klasik)
- Lampiran 4 Hasil Statistik Deskriptif (setelah memenuhi asumsi klasik)
- Lampiran 5 Hasil Pengujian Normalitas (sebelum transformasi)
- Lampiran 6 Hasil Pengujian Normalitas (setelah transformasi)
- Lampiran 7 Hasil Pengujian Heteroskedastisitas
- Lampiran 8 Hasil Pengujian Autokorelasi
- Lampiran 9 Hasil Pengujian Multikolinearitas
- Lampiran 10 Hasil Pengujian Hipotesis
- Lampiran 11 Hasil Koefisien Determinasi
- Lampiran 12 Kartu Bimbingan Skripsi Mahasiswa STIE Musi