

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	i
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang	2
1.3 Rumusan Masalah	8
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	8
1.6 Waktu dan Periode Penelitian	9
1.7 Sistematika Pembahasan	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Investasi.....	10
2.1.2 Pasar Modal.....	12
2.1.3 Saham	13
2.1.4 Indeks Harga Saham.....	13
2.1.5 Laporan Keuangan	15
2.1.6 <i>Return</i> Saham	16
2.1.7 Frekuensi Perdagangan	16

2.1.8 <i>Trading Volume Activity</i>	17
2.1.9 Nilai Kapitalisasi Pasar	17
2.1.10 Harga Saham	18
2.2 Penelitian Terdahulu.....	18
2.3 Kerangka Pemikiran	24
2.4 Hipotesis Penelitian.....	26
2.5 Ruang Lingkup Penelitian	27
BAB III METODE PENELITIAN	28
3.1 Karakteristik Penelitian	28
3.2 Variabel Operasional	29
3.3 Alat Pengumpulan Data	30
3.4 Tahapan Penelitian	31
3.5 Populasi dan Sampel	33
3.5.1 Populasi Penelitian	33
3.5.2 Sampel Penelitian	34
3.6 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	35
3.7 Teknik Analisa Data dan Pengujian Hipotesis	35
3.7.1 Analisis Statistik Deskriptif	35
3.7.2 Analisis Regresi Data Panel	35
3.7.3 Pengujian Hipotesis.....	38
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	41
4.1 Analisis Deskriptif.....	41
4.1.1 Frekuensi Perdagangan.....	41
4.1.2 <i>Trading Volume</i>	42
4.1.3 Nilai Kapitalisasi	43
4.1.4 Harga Saham	44
4.1.5 <i>Return Saham</i>	44

4.2	Pemilihan Model Estimasi Regresi Data Panel	45
4.2.1	Uji Chow	46
4.2.2	Uji Hausman	46
4.2.3	Uji Lagrange multiplier	47
4.2.4	Estimasi Persamaan Regresi Data Panel	48
4.3	Uji Hipotesis	51
4.3.1	Koefisien Determinasi	51
4.3.2	Pengujian Hipotesis Secara Simultan (Uji F).....	52
4.3.3	Pengujian Hipotesis Secara Parsial (Uji t)	53
4.4	Pembahasan Hipotesis	54
4.4.1.	Pengaruh Frekuensi Perdagangan terhadap <i>Return</i> Saham	54
4.4.2.	Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap <i>Return</i> Saham	55
4.4.3.	Pengaruh Nilai Kapitalisasi terhadap <i>Return</i> Saham.....	56
4.4.4.	Pengaruh Harga Saham terhadap <i>Return</i> Saham.....	56
4.4.5.	Pengaruh Frekuensi Perdagangan, <i>Trading Volume</i> , Nilai Kapitalisasi dan Harga Saham terhadap <i>Return</i> Saham	57
BAB V	PENUTUP	59
5.1	Kesimpulan.....	59
5.2	Saran	60
DAFTAR PUSTAKA		47
LAMPIRAN.....		51