

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	i
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR GRAFIK.....	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian.....	12
1.3.1 Tujuan Penelitian	12
1.3.2 Manfaat Penelitian	13
1.4 Sistematika Penulisan.....	13
BAB II TELAAH PUSTAKA	15
2.1 Landasan Teori	15
2.1.1 Investasi.....	15
2.1.2 Pasar Modal di Indonesia.....	16
2.1.3 Mekanisme Perdagangan Bursa Efek Indonesia	18
2.1.4 Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia	19
2.1.5 Indeks LQ45.....	20
2.1.6 Teori Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	21
2.1.7 Teori Struktur Mikro Pasar (<i>Market Microstructure Theory</i>).....	25
2.1.8 Short-Horizon Return Predictability	26
2.2 Penelitian Terdahulu.....	28
2.3 Pengaruh Antar Variabel dan Rumusan Hipotesis	39

2.3.1	Pengaruh <i>Effective Spread</i> terhadap SHRP.....	39
2.3.2	Pengaruh Frekuensi Perdagangan (<i>Trade Frequency</i>) pada SHRP	40
2.3.3	Pengaruh Harga Saham (<i>Price</i>) terhadap SHRP	41
2.3.4	Pengaruh Volume Perdagangan (<i>Volume</i>) terhadap SHRP	41
2.3.5	Pengaruh Volatilitas Harga (<i>Volatility</i>) terhadap SHRP.....	42
2.4	Kerangka Pemikiran	43
2.5	Hipotesis	44
BAB III METODE PENELITIAN.....		45
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	45
3.1.1	Variabel Penelitian	45
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	45
3.2	Populasi dan Sampel.....	51
3.3	Jenis dan Sumber Data	52
3.4	Metode Pengumpulan Data	52
3.5	Metode Analisis.....	53
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif	53
3.5.2	Uji Asumsi Klasik.....	53
3.5.3	Analisis Data	58
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		61
4.1	Deskripsi dan Objek Penelitian	61
4.2	Analisis Statistik Deskriptif.....	62
4.3	Uji Asumsi Klasik	65
4.3.1	Uji Normalitas.....	65
4.3.2	Uji Heteroskedastisitas.....	69
4.3.3	Uji Multikolinearitas	71
4.3.4	Uji Autokorelasi.....	72
4.4	Analisis Regresi Linear Berganda.....	73
4.4.1	Analisis Koefisien Determinasi R^2	73
4.4.2	Uji F	75
4.4.3	Uji T	76
4.5	Pembahasan	78
4.5.1	Bagian Pertama (Hipotesis Diterima)	78

4.5.2	Bagian Kedua (Hipotesis Ditolak)	82
BAB V PENUTUP.....		86
5.1	Kesimpulan.....	86
5.2	Keterbatasan Penelitian	89
5.3	Saran.....	89
5.3.1	Saran untuk Penelitian Selanjutnya.....	89
5.3.2	Saran untuk Investor	90
DAFTAR PUSTAKA		91
LAMPIRAN.....		95