

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
<i>ABSTRACT</i>	V
ABSTRAK	vi
MOTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xviii
DAFTAR GAMBAR.....	xix
DAFTAR LAMPIRAN	xx
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	8
1.3. Tujuan dan Kegunaan Penelitian	9
1.3.1. Tujuan Penelitian	9
1.3.2. Kegunaan Penelitian.....	10
1.3.3. Sistematika Penulisan	10

BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	14
2.1. Definisi-definisi.....	14
2.1.1. <i>Efficient Market Hypotesis</i>	14
2.1.2. <i>Speed of Stock Price Adjustment</i>	15
2.1.3. Trading Volume	16
2.1.4. Market Value.....	17
2.1.5. Likuiditas	18
2.1.6. Trading Frequency	19
2.1.7. Risiko	20
2.2. Landasan Teori.....	23
2.2.1. <i>Speed of Stock Price Adjustment</i>	23
2.2.2. <i>Trading Volume</i>	24
2.2.3. <i>Market Value</i>	25
2.2.4. Likuiditas	26
2.2.5. <i>Trading Frquency</i>	26
2.2.6. Risiko Saham	27
2.3. Penelitian Terdahulu	28
2.5. Hipotesis	29
2.4. Kerangka Pemikiran.....	37
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	38
3.1. Variabel Penelitain dan Definisi Operasional	38

3.1.1. Variabel Penelitian	38
3.1.2. Definisi Operasional.....	39
3.2. Populasi dan Sampel	44
3.3. Jenis dan Sumber Data	44
3.4. Metode Pengumpulan Data	45
3.5. Metode Analisis Data	45
3.5.1. Uji Asumsi Klasik	46
3.5.2. Analisis Regresi Linear Berganda	48
3.5.3. Pengujian Hipotesis	49
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	52
4.1. Deskripsi Objek Penelitian.....	52
4.1.1. Gambaran Umum Sampel	52
4.1.2. Koefisien <i>Speed of Adjustment</i> (G)	53
4.1.3. Statistik Deskriptif	53
4.2. Analisis Data	55
4.2.1. Uji Asumsi Klasik	55
4.2.1.1. Uji Normalitas	56
4.2.1.2. Uji Multikolinearitas.....	57
4.2.1.3. Uji Autokorelasi	59
4.2.1.4. Uji Heteroskedastisitas	59
4.2.2. Analisis Regresi Linear Beganda	60
4.2.3. Pengujian Hipotesis.....	62
4.3. Pembahasan.....	67
4.3.1. <i>Trading Volume</i>	68

4.3.2. <i>Market Value</i>	69
4.3.3. <i>Trading Frequency</i>	69
4.3.4. Risiko	70
4.3.5. Likuiditas	71
BAB V PENUTUP	72
5.1. Kesimpulan	72
5.2. Keterbatasan	73
5.3. Saran	74
DAFTAR PUSTAKA	76
LAMPIRAN A KOEFISIEN <i>DELAY G</i>	78
LAMPIRAN B VARIABEL	86
LAMPIRAN C HASIL REGRESI	91