

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRACT.....	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR.	vii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	6
1.3.1 Tujuan Penelitian	6
1.3.2 Kegunaan Penelitian	6
1.4 Sistematika Penulisan.	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Investasi	9
2.1.2 Analisis Teknikal.	10
2.1.3 Likuiditas	12
2.1.4 Return Saham.....	13
2.1.5 Frekuensi Perdagangan	15
2.1.6 Volume Perdagangan	16
2.1.7 Kapitalisasi Pasar	17
2.1.8 <i>Trading Day</i>	18
2.2 Penelitian Terdahulu	18
2.3 Kerangka Pemikiran.....	21
2.4 Hipotesis.....	22
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	23
3.1.1 Variabel Penelitian.	23
3.1.2 Definisi Operasional	23
3.2 Populasi dan Sampel	27
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	29
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	29
3.5 Metode Analisis Data.....	29
3.5.1 Pengujian Penyimpangan Asumsi Klasik	30
3.5.2 Analisis Regresi Linier Berganda	33
3.5.3 Pengujian Hipotesis.....	34

3.5.3.1	Pengujian Secara Individual (Uji t).....	34
3.5.3.2	Pengujian Secara Serentak (Uji F).....	35
3.5.4	Koefisien Determinasi.....	36
BAB IV	ANALISIS DAN PEMBAHASAN	37
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	37
4.1.1	Gambaran Umum Sampel	37
4.1.2	Statistik Deskriptif.....	38
4.1.2.1	Return Saham.	38
4.1.2.2	Frekuensi Perdagangan.....	39
4.1.2.3	Volume Perdagangan.....	41
4.1.2.4	Kapitalisasi Pasar.....	42
4.1.2.5	<i>Trading Day</i>	43
4.2	Analisis Data	45
4.2.1	Uji Asumsi Klasik.	45
4.2.1.1	Uji Normalitas.	45
4.2.1.2	Uji Multikolinearitas	46
4.2.1.3	Uji Autokorelasi.	47
4.2.1.4	Uji Heterokedastisitas.....	48
4.2.2	Analisis Regresi Linear Berganda.	49
4.2.3	Pengujian Hipotesis	51
4.2.3.1	Pengujian Secara Parsial (Uji t).....	51
4.2.3.2	Pengujian Secara Simultan (Uji F).	53
4.2.4	Koefisien Determinasi	53
4.3	Intepretasi Hasil.	54
BAB V	PENUTUP.....	57
5.1	Kesimpulan	57
5.2	Keterbatasan.....	58
5.3	Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA.	60