

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Sertifikasi	ii
Halaman Pengesahan	iii
Motto dan Persembahan	iv
<i>Abstract</i>	v
Abstrak	vi
Kata Pengantar.....	vii
Daftar Tabel.....	xiv
Daftar Gambar	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah.....	15
1.3 Tujuan Penelitian.....	16
1.4 Kegunaan Penelitian	17
BAB II TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL PENELI TIAN.....	19
2.1 Telaah Pustaka.....	19
2.1.1 Pasar Modal	19
2.1.2 Konsep Dasar Investasi	20
2.1.3 Pengertian Saham	22
2.1.4 <i> Holding Period</i>	23
2.1.5 <i> Bid-Ask Spread</i>	25

2.1.6	<i>Market Value</i>	29
2.1.7	<i>Varian Return</i>	34
2.2	Penelitian Terdahulu.....	39
2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis dan Perumusan Hipotesis	45
2.3.1	Pengaruh <i>Bid-Ask Spread</i> terhadap <i> Holding Period</i> Saham .	45
2.3.2	Pengaruh <i>Market Value</i> terhadap <i> Holding Period</i> Saham	46
2.3.3	Pengaruh <i>Varian Return</i> terhadap <i> Holding Period</i> Saham ...	47
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	49
2.5	Perumusan Hipotesis	51
2.6	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	51
2.6.1	<i> Holding Period</i>	51
2.6.2	<i> Bid Ask Spread</i>	52
2.6.3	<i>Market Value</i>	54
2.6.4	<i>Varian Return</i>	55
BAB III METODE PENELITIAN		59
3.1	Jenis dan Sumber Data	59
3.2	Populasi dan Sampel Penelitian.....	60
3.2.1	Populasi Penelitian	60
3.2.2	Sampel Penelitian	60
3.3	Metode Pengumpulan Data	63
3.4	Metode Analisis Data	63
3.4.1	Uji Asumsi Klasik	64
3.4.1.1	Uji Normalitas Data.....	64
3.4.1.2	Uji Multikolinearitas	64
3.4.1.3	Uji Heteroskedastisitas	65

3.4.1.4 Uji Autokorelasi	66
3.4.2 Analisis Regresi Linier Berganda.....	67
3.4.3 Uji Hipotesis.....	68
3.4.3.1 Uji F Statistik.....	68
3.4.3.2 Uji t Statistik.....	69
3.4.3.3 Koefisien Determinasi (R^2)	70
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	71
4.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian.....	71
4.1.1 Indeks Saham LQ 45	71
4.1.2 Gambaran Sampel Perusahaan	73
4.1.3 Analisis Deskriptif Statistik Variabel Penelitian	74
4.2 Pengujian Asumsi Klasik	75
4.2.1 Uji Normalitas Data.....	75
4.2.2 Uji Multikolinearitas	78
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas	80
4.2.4 Uji Autokorelasi	83
4.3 Pengujian Statistik	85
4.3.1 Koefisien Determinasi (R^2)	85
4.3.2 Uji F Statistik.....	87
4.3.3 Uji t Statistik.....	88
4.4 Pembahasan	93
BAB V PENUTUP	99
5.1 Kesimpulan.....	99
5.2 Implikasi Kebijakan.....	101

DAFTAR PUSTAKA.....	103
LAMPIRAN-LAMPIRAN	106