

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI	xii
ABSTRAKSI	xiii
BAB 1. PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Tujuan Penelitian.....	7
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
1.5. Sistematika Pembahasan	8
BAB 2. PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	9
2.1. Pengertian Pasar Modal	9
2.2. Pasar Modal Efisien	9
2.3. Bid-Ask Spread	14
2.4. Volume Perdagangan saham	18
2.5. Return Saham	21
2.6. Penelitian Terdahulu	22
BAB 3. METODE PENELITIAN	25

3.1. Data dan Sumber Data	25
3.2. Populasi dan Prosedur Pengambilan Sampel	25
3.2.1. Populasi Penelitian	25
3.2.2. Sampel dan Teknik Samplin.....	25
3.3. Variabel Penelitian	27
3.3.1. Variabel Dependen	27
3.3.2. Variabel Independen	28
3.4. Alat Analisis Data	28
3.5. Uji Statistik	29
3.6. Pengujian Asumsi Klasik	30
BAB 4. ANALISIS DATA	33
4.1. Gambaran Umum Obyek Penelitian	33
4.2. Analisis Data	34
4.2.1. Uji Asumsi Klasik	34
4.2.1.1. Uji Normalitas Data	34
4.2.1.2. Uji Autokorelasi	35
4.2.1.3. Uji Heteroskedastisitas	37
4.2.1.4. Uji Multikolinearitas	38
4.2.2. Uji Regresi	39
4.2.3. Uji Statistik F	42
4.2.4. Uji Statistik t	43
4.2.5. Analisis Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap Bid-Ask Spread Saham	44

4.2.6. Analisis Pengaruh Return Saham Terhadap Bid-Ask	
Spread saham	45
BAB 5. KESIMPULAN DAN SARAN	47
5.3. Kesimpulan	47
5.4. Keterbatasan Penelitian	48
5.5. Saran	48
DAFTAR PUSTAKA	49
LAMPIRAN	52