



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Tujuan Penelitian	5
1.4. Manfaat Penelitian	6
1.5. Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1. Tinjauan Pustaka	7
2.2. Landasan Teori	11
2.2.1. Likuiditas	11
2.2.2. Volume Perdagangan	12
2.2.3. Frekuensi Perdagangan	13
2.2.4. <i>Bid-Ask Spread</i>	14
2.2.5. <i>Return Saham</i>	16
2.3. Hipotesis	17



2.3.1.	Volume Transaksi dan Return Saham.....	17
2.3.2.	Frekuensi perdagangan dan Return Saham	19
2.3.3.	<i>Bid-ask Spread</i> dan Return Saham	21
BAB III METODE PENELITIAN		24
3.1.	Data dan Sampel Penelitian.....	24
3.2.	Variabel Penelitian.....	25
3.3.	Metode Analisis Data.....	27
3.3.1.	Uji Hipotesis.....	27
3.3.1.1.	Model Regresi Linear Berganda	27
3.3.1.2.	Uji t.....	28
3.3.1.3.	Uji F (ANOVA)	28
3.3.1.4.	Koefisien Determinasi (R^2).....	29
3.3.2.	Uji Asumsi Klasik.....	29
3.3.2.1.	Uji Normalitas.....	29
3.3.2.2.	Uji Multikolinieritas	30
3.3.2.3.	Uji Autokorelasi	30
3.3.2.4.	Uji Heteroskedastisitas	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		32
4.1.	Statistik Deskriptif	32
4.2.	Hasil Penelitian.....	33
4.2.1.	Pengujian Hipotesis dengan Uji Statistik t.....	33
4.2.2.	Pengujian Hipotesis dengan Uji Statistik F.....	35
4.2.3.	Analisis Koefisien Determinasi (R^2).....	35
4.3.	Pembahasan	36
4.3.1.	Volume Perdagangan terhadap Return Saham.....	36



4.3.2.	Frekuensi Perdagangan terhadap Return Saham	38
4.3.3.	<i>Bid-Ask Spread</i> terhadap Return Saham	39
4.4.	Uji Asumsi Klasik	40
4.4.1.	Uji Normalisasi	40
4.4.2.	Uji Multikolinieritas	41
4.4.3.	Uji Autokorelasi	42
4.4.4.	Uji Heteroskedastisitas	42
BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN, IMPLIKASI DAN SARAN...		44
5.1.	Kesimpulan Penelitian	44
5.2.	Keterbatasan Penelitian	45
5.3.	Implikasi Hasil Penelitian	45
5.4.	Saran Penelitian	46
DAFTAR PUSTAKA		47
LAMPIRAN		50