

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
ABSTRAKSI	xiv
ABSTRACT	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1 Pasar Modal	10
2.2 <i>Return</i> Saham	10
2.3 Volume Perdagangan	12

2.4	Harga Saham	14
2.5	Varian <i>Return</i> Saham	15
2.6	<i>Bid-Ask Spread</i>	16
2.7	Penelitian Terdahulu	18
2.8	Hipotesis	20
2.8.1	Pengaruh <i>Return</i> Saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	20
2.8.2	Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	21
2.8.3	Pengaruh Varian <i>Return</i> Saham terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	22
2.9	Kerangka Pemikiran Teoritis	23
BAB III METODELOGI PENELITIAN		25
3.1.	Jenis Penelitian	25
3.2.	Populasi dan Teknik Sampling	25
3.3.	Definisi Oprasional dan Pengukuran Variabel	26
3.3.1.	Variabel / Penelitian	26
3.3.2.	Definisi Oprasional	26
3.4.	Jenis dan Data Sumber	30
3.5.	Metode Pengumpulan Data	30
3.6.	Teknik Analisis	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		35
4.1.	Statistik Deskriptif	35
4.2.	Uji Asumsi Klasik	38
4.2.1	Normalitas Data	38

4.2.2	Uji Multikolinearitas	39
4.2.3	Uji Autokorelasi	41
4.2.4	Uji Heteroskedastisitas	42
4.3.	Persamaan Regresi	43
4.3.1.	Model Persamaan Regresi Berganda	43
4.3.2.	Pengujian Hipotesis (Uji t)	44
4.3.3.	Pengujian Model Regresi (Uji F)	46
4.4.	Koefisien Determinasi (R^2)	46
4.5.	Pembahasan	47
4.5.1.	Pengaruh <i>Return</i> Saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	47
4.5.2.	Pengaruh Volume Perdagangan saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	48
4.5.3.	Pengaruh Varian <i>Return</i> Saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	49
4.5.4.	Pengaruh Harga Saham Terhadap <i>Bid-Ask Spread</i>	49
BAB V PENUTUP		50
5.1	Kesimpulan	50
5.2	Saran	51
5.3	Keterbatasan	51
5.4	Agenda Penelitian Yang Akan Datang	52
DAFTAR PUSTAKA		53
LAMPIRAN		55