

DAFTAR ISI

HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI.....	iv
HALAMAN PERNYATAAN DEWAN PENGUJI SKRIPSI	v
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	vi
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI/TESIS	vii
ABSTRAK.....	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pembatasan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1.5.1 Manfaat Akademis.....	6
1.5.2 Manfaat Praktis	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	7
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori.....	8
2.1.1 Manajemen Keuangan	8
2.1.2 Pasar Modal	9
2.1.3 Efficient Market Hypothesis Theory	13
2.1.4 Singnaling Theory	14
2.1.5 Return Saham.....	14

2.1.6	Frekuensi Perdagangan	16
2.1.7	Volume Perdagangan	17
2.1.8	Kapitalisasi Pasar	18
2.1.9	Trading Day	20
2.2	Tinjauan Penelitian Terdahulu	21
BAB 3 METODOLOGI PENELITIAN		
3.1	Metode Konseptual	28
3.2	Variabel Penelitian	29
3.2.1	Variabel Bebas (Independent Variabel) (X)	29
3.2.2	Variabel Terikat (Dependent Variabel)	30
3.2.3	Operasionalisasi Variabel	31
3.3	Hubungan Antara Variabel dan Hipotesis	32
3.3.1	Pengaruh Frekuensi Perdagangan terhadap Return Saham	32
3.3.2	Pengaruh Volume Perdagangan terhadap Return Saham	32
3.3.3	Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham	33
3.3.4	Pengaruh Trading Day Terhadap Return Saham	33
3.4	Unit Analisis, Populasi dan Sampel	33
3.4.1	Populasi	34
3.4.2	Sampel	34
3.5	Metode Analisis	34
3.5.1	Statistik Deskriptif	35
3.5.2	Uji Asumsi Klasik	35
3.5.3	Uji Kelayakan Model	36
3.5.4	Analisis Regresi Berganda	37
3.5.5	Pengujian Hipotesis	38
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN		
4.1	Gambaran Umum Penelitian	40
4.2	Analisis Data	42
4.2.1	Uji Asumsi Klasik	42
4.2.2	Uji Multikolinearitas	42

4.2.3 Uji Heteroskedastisitas	42
4.2.4 Uji Kelayakan Model	43
4.2.5 Uji Chow	43
4.2.6 Uji Hausman.....	44
4.2.7 Uji Regresi Linier Berganda.....	44
4.2.8 Pengujian Hipotesis.....	45
4.2.9 Koefisien Determinasi	46
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan.....	48
5.2 Implikasi Manajerial	48
5.3 Keterbatasan Penelitian	48
5.4 Saran.....	48
DAFTAR PUSTAKA	50
RIWAYAT HIDUP.....	52
LAMPIRAN-LAMPIRAN	



KALBIS Institute

Transforming • Heart and Mind

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1 Kerangka Konseptual	29
------------------------------------	----



DAFTAR TABEL

Tabel. 1 Tinjauan Penelitian Terdahulu	25
Tabel. 2 Operasional Variabel-variabel Penelitian	33
Tabel. 3 Hasil Purposive Sampling.....	34
Tabel. 4 Statistik Deskriptif	36
Tabel. 5 Hasil Uji Multikolinearitas	37
Tabel. 6 Heteroskedasticity Test.....	37
Tabel. 7 Hasil Uji Chow	38
Tabel. 8 Hasil Uji Husman.....	38
Tabel. 9 Hasil Regresi Linear Berganda dan Uji t	38
Tabel. 10 Koefisien Determinasi	40



KALBIS Institute

Transforming • Heart and Mind

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Perusahaan Sektor Pertanian Yang terdaftar di BEI.....	L1
Lampiran 2. Perusahaan yang Digunakan Untuk Sampel.....	L2
Lampiran 3. Output Data	L6

