

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Persetujuan pembimbing	ii
Lembar Pengesahan	iii
Pernyataan Keaslian.....	iv
Motto.....	v
Persembahan.....	vi
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel.....	xiii
Daftar Gambar	xiv
Daftar Lampiran	xv
Abstrak.....	xvi
Abstract.....	xvii
 BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Dan Pembatasan Masalah	19
C. Rumusan Masalah	19
D. Tujuan Penelitian	21
E. Kegunaan Penelitian.....	22
F. Penegasan Istilah.....	23
G. Sistematika Pembahasan	25
 BAB II LANDASAN TEORI	

A. Kajian Pustaka	27
1. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	27
2. Teori Efisiensi Pasar	28
3. <i>Return Saham</i>	29
4. Volume Perdagangan Saham	33
5. Frekuensi Perdagangan Saham	35
6. Kapitalisasi Pasar	37
7. Beta Saham	40
8. <i>Bid-Ask Spread</i>	43
9. Investasi	47
10. Pengertian Pasar Modal	52
11. Saham	55
12. Saham Syariah	59
13. Indek LQ45.....	64
14. Hubungan Antar Variabel	68
B. Penelitian Terdahulu	87
C. Kerangka Konseptual.....	140
D. Hipotesis Penelitian.....	145
 BAB III METODE PENELITIAN	
A. Rancangan Penelitian	147
1. Pendekatan Penelitian.....	147
2. Jenis Penelitian	148
B. Populasi dan Sampel Penelitian.....	148

1. Populasi.....	148
2. Sampel	149
C. Sumber dan Teknik Pengumpulan data.....	149
1. Sumber Data.....	149
2. Teknik Pengumpulan Data.....	151
D. Instrumen Penelitian.....	151
E. Teknik Analisis Data.....	155
1. Analisis Statistik Deskriptif.....	156
2. Uji Analisis Jalur (<i>path analysis</i>)	156
3. Smart <i>Partial Least Square</i> (PLS) dalam Statistika Inferensial.....	157

BAB IV HASIL PENELITIAN

A. Deskripsi Data.....	165
1. Gambaran Umum Index LQ45.....	165
2. Volume Perdagangan Saham	166
3. Frekuensi Perdagangan Saham	168
4. Kapitalisasi Pasar	170
5. Beta Saham	173
6. <i>Bid-Ask Spread</i>	178
7. <i>Return</i> Saham	179
8. Analisis Deskripif	181
B. Analisis Inferensial.....	183
1. Model Pengukuran (<i>Outer Model</i>).....	183

2. Model Struktural (<i>Inner Model</i>)	186
--	-----

BAB V PEMBAHASAN

A. Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap <i>Return</i> Saham	199
B. Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham Terhadap <i>Return</i> Saham .	202
C. Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Return</i> Saham	206
D. Pengaruh Beta Saham Terhadap <i>Return</i> Saham	210
E. Pengaruh <i>Bid-Ask Spread</i> Terhadap <i>Return</i> Saham.....	214
F. Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap <i>Return</i> Saham Melalui <i>Bid-Ask Spread</i>	217
G. Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham Terhadap <i>Return</i> Saham Melalui <i>Bid-Ask Spread</i>	220
H. Pengaruh Kapitalisasi Pasar Terhadap <i>Return</i> Saham Melalui <i>Bid-Ask Spread</i>	223
I. Pengaruh Beta Saham Terhadap <i>Return</i> Saham Melalui <i>Bid-Ask Spread</i>	225

BAB VI PENUTUP

A. Kesimpulan	229
B. Saran.....	232
Daftar Rujukan	235
Lampiran- lampiran	