

DAFTAR ISI

<u>HALAMAN SAMPUL</u>	i
<u>HALAMAN JUDUL</u>	ii
<u>HALAMAN PENGESAHAN</u>	iii
<u>HALAMAN PERNYATAAN</u>	iv
<u>KATA PENGANTAR</u>	v
<u>ABSTRAK</u>	vii
<u>ABSTRACT</u>	viii
<u>DAFTAR ISI</u>	ix
<u>BAB 1</u>	1
<u>PENDAHULUAN</u>	1
1.1 <u>Gambaran Umum Objek Penelitian</u>	1
1.2 <u>Latar Belakang</u>	3
1.3 <u>Perumusan Masalah</u>	10
1.4 <u>Pertanyaan Penelitian</u>	10
1.5 <u>Tujuan Penelitian</u>	11
1.6 <u>Manfaat Penelitian</u>	11
1.7 <u>Ruang Lingkup Penelitian</u>	12
1.8 <u>Sistematika Penelitian</u>	13
<u>BAB 2</u>	14
<u>TINJAUAN PUSTAKAN DAN LINGKUP PENELITIAN</u>	14
2.1 <u>Landasan Teori</u>	14
2.1.1 <u>Pasar Modal</u>	14
2.1.2 <u>Investasi</u>	14
2.1.3 <u>Dasar Keputusan Investasi</u>	16
2.1.4 <u>Resiko Investasi</u>	17
2.1.5 <u>Proses Keputusan Investasi</u>	18
2.1.6 <u>Saham</u>	19
2.1.7 <u>Likuiditas</u>	19
2.1.8 <u>Volume Perdagangan</u>	20
2.1.9 <u>Frekuensi Perdagangan</u>	20
2.1.10 <u>Kapitalisasi Pasar</u>	21
2.2 <u>Penelitian Terdahulu</u>	21
2.3 <u>Kerangka Pemikiran</u>	25
2.4 <u>Hipotesis Penelitian</u>	29
<u>BAB 3</u>	31
<u>METODE PENELITIAN</u>	31
3.1 <u>Karakteristik Penelitian</u>	31
3.2 <u>Variabel Operasional</u>	32
3.3 <u>Alat Pengumpulan Data</u>	33
3.4 <u>Tahapan Penelitian</u>	33
3.5 <u>Populasi dan Sampel</u>	36
3.6 <u>Pengumpulan Data dan Sumber Data</u>	37
3.7 <u>Teknik Analisa Data dan Pengujian Hipotesis</u>	37

3.7.1	<u>Analisis Deskriptif</u>	37
3.7.2	<u>Regresi Data Panel</u>	38
3.7.3	<u>Model Estimasi Data Panel</u>	41
3.7.4	<u>Pengujian Hipotesis</u>	42
<u>BAB IV</u>		45
<u>HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN</u>		45
4.1	<u>Analisis Deskriptif</u>	45
4.1.1	<u>Frekuensi Perdagangan Saham</u>	45
4.1.2	<u>Volume Perdagangan Saham</u>	46
4.1.3	<u>Kapitalisasi Pasar</u>	47
4.1.4	<u>Return Saham</u>	48
4.2	<u>Pemilihan Model Estimasi Regresi Data Panel</u>	49
4.2.1	<u>Uji Chow</u>	49
4.2.2	<u>Uji Hausman</u>	50
4.2.3	<u>Estimasi Persamaan Regresi Data Panel</u>	50
4.3	<u>Uji Hipotesis</u>	53
4.3.1	<u>Koefisien Determinasi</u>	53
4.3.2	<u>Pengujian Hipotesis Secara Simultan (Uji F)</u>	53
4.3.3	<u>Pengujian Hipotesis Secara Parsial (Uji t)</u>	54
4.4	<u>Pembahasan hipotesis</u>	56
<u>Bab V</u>		59
<u>Kesimpulan dan Saran</u>		59
5.1	<u>Kesimpulan</u>	59
5.2	<u>Saran</u>	59
<u>DAFTAR PUSTAKA</u>		61
<u>LAMPIRAN</u>		68