

## DAFTAR ISI

|                                          | Halaman |
|------------------------------------------|---------|
| HALAMAN JUDUL.....                       | i       |
| HALAMAN PERSETUJUAN.....                 | ii      |
| HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN ..... | iii     |
| PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....    | iv      |
| ABSTRACT.....                            | v       |
| MOTO DAN PERSEMBAHAN .....               | vii     |
| KATA PENGANTAR .....                     | viii    |
| DAFTAR TABEL.....                        | xiv     |
| DAFTAR GAMBAR .....                      | xv      |
| BAB I PENDAHULUAN .....                  | 1       |
| 1.1 Latar Belakang Masalah .....         | 1       |
| 1.2 Rumusan Masalah .....                | 9       |
| 1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....  | 10      |
| 1.3.1 Tujuan Penelitian.....             | 10      |
| 1.3.2 Manfaat Penelitian.....            | 10      |
| 1.4 Sistematika Penulisan.....           | 11      |
| BAB II TELAAH PUSTAKA .....              | 13      |
| 2.1 Landasan Teori .....                 | 13      |
| 2.1.1 Teori Agensi .....                 | 13      |
| 2.1.2 Asimetri Informasi.....            | 15      |
| 2.1.3 Bid-Ask Spread .....               | 16      |

|                                |                                                            |    |
|--------------------------------|------------------------------------------------------------|----|
| 2.1.4                          | Volumer Perdagangan .....                                  | 18 |
| 2.1.5                          | Ukuran Perusahaan .....                                    | 18 |
| 2.1.6                          | Harga Saham.....                                           | 20 |
| 2.1.7                          | <i>Depth</i> .....                                         | 21 |
| 2.2                            | Penelitian Terdahulu.....                                  | 21 |
| 2.3                            | Kerangka Pemikiran .....                                   | 23 |
| 2.4                            | Pengembangan Hipotesis.....                                | 26 |
| BAB III METODE PENELITIAN..... |                                                            | 27 |
| 3.1                            | Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel..... | 27 |
| 3.1.1                          | Variabel Dependen .....                                    | 27 |
| 3.1.2                          | Variabel Independen.....                                   | 30 |
| 3.3.3                          | Variabel Kontrol .....                                     | 32 |
| 3.2                            | Populasi dan Sampel.....                                   | 35 |
| 3.3                            | Jenis dan Sumber Data .....                                | 36 |
| 3.4                            | Metode Pengumpulan Data .....                              | 36 |
| 3.5                            | Metode Analisis Data .....                                 | 37 |
| 3.5.1                          | Analisis Statistik Deskriptif.....                         | 37 |
| 3.5.2                          | Uji Asumsi Klasik .....                                    | 37 |
| 3.5.2.1                        | Uji Normalitas.....                                        | 37 |
| 3.5.2.2                        | Uji Multikolonieritas.....                                 | 38 |
| 3.5.2.3                        | Uji Heterokedastisitas .....                               | 38 |
| 3.5.2.4                        | Analisis Regresi .....                                     | 39 |
| 3.5.3                          | Uji Hipotesis .....                                        | 40 |

|                                                  |    |
|--------------------------------------------------|----|
| 3.5.3.1 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ )..... | 40 |
| 3.5.3.2 Uji Uji Statistik F .....                | 40 |
| 3.5.4.3 Uji Statistik T.....                     | 40 |
| BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....                 | 41 |
| 4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....              | 41 |
| 4.1.1 Sample Penelitian .....                    | 41 |
| 4.1.2 Statistik Deskriptif.....                  | 43 |
| 4.2 Analisis Data .....                          | 45 |
| 4.2.1 Screening Data.....                        | 45 |
| 4.2.2 Hasil Uji Asumsi Klasik.....               | 46 |
| 4.2.2.1 Uji Normalitas.....                      | 46 |
| 4.2.2.2 Uji Multikolonieritas.....               | 47 |
| 4.2.2.3 Uji Heterokedastisitas .....             | 48 |
| 4.2.2.4 Uji Autokorelasi.....                    | 49 |
| 4.2.3 Model Regresi.....                         | 50 |
| 4.2.4 Uji Statistik F .....                      | 52 |
| 4.2.5 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....  | 54 |
| 4.2.6 Uji Statistik T.....                       | 55 |
| 4.3 Pembahasan .....                             | 57 |
| BAB V PENUTUP.....                               | 59 |
| 5.1 Kesimpulan.....                              | 59 |
| 5.2 Keterbatasan .....                           | 59 |
| 5.3 Saran.....                                   | 60 |
| DAFTAR PUSTAKA .....                             | 61 |