

DAFTAR ISI

SERTIFIKASI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
MOTTO	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Tujuan Penelitian	15
BAB II TELAAH PUSTAKA	16
2.1 Indeks Harga Saham Gabungan	16
2.2 Volume Perdagangan Saham.....	17
2.3 Return Saham.....	20
2.4 Teori Sinyal.....	22
2.5 Teori Efisiensi Pasar	24
2.6 Pengaruh Indeks Harga Saham Gabungan terhadap Return Saham.....	25
2.7 Pengaruh Volume Perdagangan Saham terhadap Return Saham.....	29
2.8 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	31
2.9 Hipotesis	32

BAB III METODE PENELITIAN	33
3.1 Jenis dan Sumber Data	33
3.2 Populasi dan Sampel	34
3.2.1 Populasi	34
3.2.2 Sampel.....	35
3.3 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	38
3.3.1 Variabel Penelitian yang digunakan.....	38
3.3.1.1 Variabel Independen	38
3.3.1.2 Variabel Dependen.....	40
3.3.2.1 Return Saham	41
3.4 Metode Pengumpulan Data	46
3.4.1 Teknik Analisis	46
3.4.2 Metode Estimasi Model Regresi	47
3.4.3 Uji Asumsi klasik.....	49
3.4.4 Uji Normalitas.....	49
3.4.5 Uji Autokorelasi.....	50
3.4.6 Uji Multikoleniaritas.....	51
3.4.7 Uji Heteroskedastisitas	52
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	54
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	54
4.1.1 Analisis Deskriptif	55
4.2 Analisis Data dan Hasil.....	58
4.2.1 Uji Asumsi Klasik	58
4.3 Uji Hipotesis.....	69
4.3.1 Pengujian Hipotesis.....	70
4.4 Pembahasan	77

4.4.1 Pengaruh Indeks harga saham gabungan terhadap Return	
Saham	77
4.4.2 Pengaruh Volume perdagangan saham terhadap Return	
Saham	79
BAB V SIMPULAN DAN IMPLIKASI KEBIJAKAN	82
5.1 Simpulan	82
5.2 Implikasi Teoritis	86
5.3 Keterbatasan Penelitian.....	87
5.4 Saran pada penelitian selanjutnya	87
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN.....	93
CURRICULUM VITAE.....	157
LATAR BELAKANG PENDIDIKAN.....	158
PENGALAMAN KERJA.....	158
PENDIDIKAN DAN PELATIHAN.....	158

FEB UNDIP