

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
ABSTRAK	iv
MOTTO	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi dan Perumusan Masalah	17
C. Tujuan Penelitian	17
D. Batasan Penelitian	18
E. Manfaat Penelitian	18
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	21
A. Landasan Teori.....	21
1. <i>Signaling Theory</i>	21
2. Teori Investasi	26
3. <i> Holding Period</i>	28
4. Bid-Ask Spread	29
5. Market Value.....	33
6. Analisis Fundamental.....	34
B. Penelitian Terdahulu dan Pembentukan Hipotesis.....	43
C. Kerangka Konseptual /Kerangka Penelitian	60
BAB III METODE PENELITIAN	62
A. Rancangan Penelitian	62
B. Populasi	62

C. Sample dan Teknik Sampling	63
D. Jenis Data Penelitian	64
E. Prosedur Pengambilan Data	65
F. Klasifikasi Variabel Penelitian.....	66
G. Definisi Operasional Variabel.....	67
H. Teknis Analisis Data	71
BAB IV ANALISIS HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	83
A. Analisis dan Hasil Penelitian	83
B. Pembahasan Hasil Penelitian	112
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	127
A. Kesimpulan	127
B. Saran.....	128
DAFTAR PUSTAKA	131
LAMPIRAN.....	137

DAFTAR TABEL

Tabel 1. 1 Temuan Hasil Penelitian Terdahulu.....	11
Tabel 1. 2 Penelitian Terdahulu di Luar Negeri:.....	14
Tabel 3. 1 Ringkasan Pemilihan Sampel	64
Tabel 3. 2 Bentuk Transformasi Data	72
Tabel 4. 1 Statistik Deskriptif	95
Tabel 4. 2 Hasil Uji Normalitas	100
Tabel 4. 3 Hasil Uji Multikolonieritas	101
Tabel 4. 4 Hasil Uji Heteroskedastisitas	102
Tabel 4. 5 Hasil Uji Autokorelasi	103
Tabel 4. 6 Hasil Uji Autokorelasi Setelah Pengobatan	104
Tabel 4. 7 Hasil Uji Regresi Linear Berganda	105
Tabel 4. 8 Hasil Uji Koefisien Determinasi (Uji R^2)	108
Tabel 4. 9 Hasil Uji Signifikansi Anova (Uji Statistik F)	107
Tabel 4. 10 Hasil Uji Signifikansi Parameter (Uji t).....	110

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Perkembangan Emiten dan Investor di BEI Periode 2016-2020.....	3
Gambar 1. 2 Grafik Rata- Rata Holding Period Saham Indeks LQ45	6
Gambar 2. 1 Kerangka Konseptual	60
Gambar 4. 1 Rata-Rata Holding Period Saham Perusahaan Sampel	83
Gambar 4. 2 Rata-Rata Bid-Ask Spread Saham Perusahaan Sampel	85
Gambar 4. 3 Rata-Rata Market Value Saham Perusahaan Sampel.....	87
Gambar 4. 4 Rata-Rata Earning Per Share Saham Perusahaan Sampel.....	88
Gambar 4. 5 Rata-Rata Return On Equity Saham Perusahaan Sampel	90
Gambar 4. 6 Rata-Rata Return On Investment Saham Perusahaan Sampel	91
Gambar 4. 7 Rata-Rata Price To Book Value Saham Perusahaan Sampel.....	93
Gambar 4. 8 Grafik Histogram MV dan EPS	99

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 POPULASI PENELITIAN	137
LAMPIRAN 2 SAMPEL PENELITIAN.....	139
LAMPIRAN 3 TABEL JUMLAH SAHAM BEREDAR.....	140
LAMPIRAN 4 TABEL VOLUME PERDAGANGAN SAHAM.....	142
LAMPIRAN 5 TABEL BID-ASK.....	144
LAMPIRAN 6 TABEL HARGA SAHAM PENUTUPAN	146
LAMPIRAN 7 TABEL LABA BERSIH.....	147
LAMPIRAN 8 TABEL TOTAL EKUITAS.....	149
LAMPIRAN 9 TABEL TOTAL AKTIVA	151
LAMPIRAN 10 TABEL BOOK VALUE	153
LAMPIRAN 11 TABEL PERHITUNGAN HOLDING PERIOD SAHAM	153
LAMPIRAN 12 TABEL PERHITUNGAN BID-ASK SPREAD SAHAM	155
LAMPIRAN 13 TABEL PERHITUNGAN MARKET VALUE	156
LAMPIRAN 14 TABEL PERHITUNGAN EARNING PER SHARE	158
LAMPIRAN 15 TABEL PERHITUNGAN RETURN ON EQUITY.....	159
LAMPIRAN 16 TABEL PERHITUNGAN RETURN ON INVESTMENT	160
LAMPIRAN 17 TABEL PERHITUNGAN PRICE TO BOOK VALUE.....	161
LAMPIRAN 18 TABULASI DATA SPSS 25	162
LAMPIRAN 19 HASIL OLAH DATA	166
LAMPIRAN 20 TABEL PENELITIAN TERDAHULU	171