

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN KEASLIAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
MOTTO	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
ABSTRAK	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah.....	8
C. Tujuan Penelitian	9
D. Manfaat Penelitian	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA	11
A. Landasan Teori	11
1. Teori Efisiensi Pasar (<i>Efficient Market Hypothesis</i>).....	11
2. Informasi Asimetri (<i>Asymmetric Information</i>)	15
3. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	17
4. <i>Return Saham</i>	18
5. Frekuensi Perdagangan.....	20
6. Volume Perdagangan	22
7. Kapitalisasi Pasar	24
B. Penelitian Terdahulu	25
C. Pengaruh Variabel Independen Terhadap Variabel Dependen	33
D. Kerangka Konseptual.....	38
E. Hipotesis Penelitian	39
BAB III METODE PENELITIAN	40

A. Rancangan Penelitian.....	40
B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	40
C. Populasi.....	40
D. Sampel dan Teknik <i>Sampling</i>	41
E. Jenis Data dan Sumber Data.....	42
F. Teknik Pengumpulan Data.....	42
G. Definisi Operasional Variabel dan Pengukuran Variabel.....	43
1. Variabel Dependen.....	43
2. Variabel Independen.....	43
H. Teknik Analisis Data.....	45
I. Uji Asumsi Klasik.....	46
J. Pengujian Hipotesis Penelitian.....	48
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	53
A. Analisis Deskriptif.....	53
B. Hasil Penelitian.....	53
1. Analisis Statistik Deskriptif Awal.....	53
2. Analisis Regresi Berganda Awal.....	55
3. Uji Asumsi Klasik Awal.....	58
4. Perbaikan dan Perbandingan Hasil Regresi.....	59
5. Statistik Deskriptif Setelah Perbaikan.....	60
6. Analisis Regresi Berganda Setelah Perbaikan.....	62
7. Uji Asumsi Setelah Perbaikan.....	65
8. Uji Hipotesis.....	68
C. Pembahasan.....	71
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	81
DAFTAR PUSTAKA.....	83
LAMPIRAN.....	87

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Indeks Harga Saham Gabungan	2
Gambar 1. 2 Indeks Harga Saham Keuangan.....	3
Gambar 2. 1 Kerangka Konseptual.....	39

DAFTAR TABEL

Tabel 1. 1 Frekuensi Perdagangan Saham Sektor Keuangan.....	5
Tabel 1. 2 Volume Perdagangan Saham Sektor Keuangan.....	6
Tabel 1. 3 Kapitalisasi Pasar Saham Sektor Keuangan	7
Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu.....	27
Tabel 3. 1 Populasi Penelitian	41
Tabel 3. 2 Pengambilan Sampel Penelitian	42
Tabel 3. 3 Kriteria Pengambilan Keputusan Uji Durbin-Watson.....	49
Tabel 4. 1 Hasil Analisis Statistik Deskriptif Awal.....	54
Tabel 4. 2 Analisis Regresi Berganda Awal	56
Tabel 4. 3 Uji Normalitas Awal.....	58
Tabel 4. 4 Perbandingan Hasil Regresi Sebelum dan Setelah Perbaikan	60
Tabel 4. 5 Statistik Deskriptif Setelah Perbaikan	61
Tabel 4. 6 Hasil Analisis Regresi Berganda Setelah Perbaikan	63
Tabel 4. 7 Uji Normalitas Setelah Perbaikan	65
Tabel 4. 8 Uji Multikolinieritas Setelah Perbaikan	66
Tabel 4. 9 Uji Heteroskedastisitas Setelah Perbaikan.....	67
Tabel 4. 10 Uji Autokorelasi Setelah Perbaikan.....	67
Tabel 4. 11 Uji F.....	68
Tabel 4. 12 Koefisien Determinasi	69
Tabel 4. 13 Uji t.....	70

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Populas Penelitian	88
Lampiran 2 Sampel Penelitian.....	91
Lampiran 3 Data return saham perusahaan sampel tahun 2020- 2022	93
Lampiran 4 Data frekuensi perdagangan perusahaan sampel tahun 2020-2022 .	100
Lampiran 5 Data Volume Perdagangan Sampel Tahun 2020 – 2022.....	105
Lampiran 6 Data Kapitalisasi pasar Sampel Tahun 2020 – 2022.....	115
Lampiran 7 Hasil Olah Data SPSS Awal	124
Lampiran 8 Hasil Olah Data SPSS Setelah Perbaikan.....	125