

DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK	ii
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
LEMBAR MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Perumusan Masalah	11
C. Tujuan Penelitian	11
D. Kegunaan Penelitian.....	12
BAB II KAJIAN TEORITIK.....	14
A. Deskripsi Konseptual	14
1. Teori Sinyal (Signaling Theory)	14
2. Investasi	15
3. Pasar Modal	19
4. Investor	21
5. Pengelompokan Kinerja Saham.....	23
6. Indeks Kompas 100.....	25
7. <i> Holding Period</i>	27
8. <i> Bid-Ask Spread</i>	30
9. <i> Return on Asset</i>	31
10. <i> Market Value</i>	32
11. <i> Earning per Share</i>	33
B. Hasil Penelitian yang Relevan	34
C. Kerangka Teoritik	38

D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	39
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	46
A. Objek dan Lingkup Penelitian.....	46
B. Metode Penelitian.....	46
C. Populasi dan Sampling atau Jenis dan Sumber Data	47
D. Operasional Variabel Penelitian.....	48
E. Teknik Analisis Data.....	52
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	62
A. Deskripsi Data.....	62
1. Hasil Pemilihan Sampel.....	62
2. Statistik Deskriptif	63
B. Pengujian Hipotesis.....	68
1. Uji Asumsi Klasik.....	68
2. Uji Regresi Linear Berganda	74
3. Pengujian Hipotesis	76
C. Pembahasan Hasil	79
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN	86
A. Kesimpulan	86
B. Implikasi.....	87
C. Saran.....	88
DAFTAR PUSTAKA	90
LAMPIRAN.....	93
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	208

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel II. 1 Hasil Penelitian Relevan (Tabel <i>Literature Review</i>).....	35
Tabel III. 1 Pengambilan Keputusan Uji Autokorelasi.....	55
Tabel IV. 1 Perhitungan Pemilihan Sampel.....	62
Tabel IV. 2 Hasil Uji Statistik Deskriptif	63
Tabel IV. 3 Hasil Uji Normalitas Data.....	69
Tabel IV. 4 Hasil Uji Normalitas Data (Model Log-Log)	70
Tabel IV. 5 Hasil Uji Tolerance dan VIF.....	71
Tabel IV. 6 Hasil Uji Glejser	73
Tabel IV. 7 Uji Autokorelasi Durbin-Watson.....	74
Tabel IV. 8 Analisis Regresi Linear Berganda	75
Tabel IV. 9 Hasil Uji t.....	77
Tabel IV. 10 Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	79

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar II. 1 Kerangka Konseptual	38

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1: Daftar Perusahaan Sampel.....	94
Lampiran 2: Perhitungan <i> Holding Period</i>	96
Lampiran 3: Perhitungan <i> Bid-Ask Spread</i>	101
Lampiran 4: Perhitungan <i> Return on Asset</i>	167
Lampiran 5: Perhitungan Market Value.....	172
Lampiran 6: Perhitungan Earning Per Share.....	177
Lampiran 7: Data Sebelum Ditransformasi	184
Lampiran 8: Data Setelah Logaritma Natural	189
Lampiran 9: Uji Statistik Deskriptif.....	194
Lampiran 10: Uji Normalitas Sebelum Transformasi	195
Lampiran 11: Uji Normalitas Semi-Log (Model Log-Lin).....	196
Lampiran 12: Uji Heteroskedastisitas Model Log-Lin	197
Lampiran 13: Uji Normalitas Lin-Log.....	199
Lampiran 14: Uji Normalitas Model Log-Log (Model Double Log)	200
Lampiran 15: Uji Multikolinearitas Model Log-Log.....	201
Lampiran 16: Uji Heterokedastisitas (Uji Glejser) Model Log-Log.....	203
Lampiran 17: Uji Autokorelasi, Uji Regresi Berganda, Uji t dan Uji F	205