

## DAFTAR ISI

<b>ABSTRAK .....</b>	<b>iii</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>iv</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI .....</b>	<b>v</b>
<b>PERNYATAAN ORISINALITAS.....</b>	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xiii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
A.    Latar Belakang Masalah .....	1
B.    Rumusan Masalah .....	6
C.    Tujuan Penelitian.....	7
D.    Manfaat Penelitian.....	7
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA .....</b>	<b>9</b>
A.    Deskripsi Konseptual .....	9
1. <i>Bid-Ask Spread</i> .....	9
2.    Fraksi Harga Saham .....	14
3.    Volatilitas Harga Saham .....	17
4.    Volume Perdagangan Saham .....	21
B.    Penelitian Terdahulu.....	22
C.    Kerangka Pemikiran .....	30
4.    Perumusan Hipotesis .....	33
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b>	<b>34</b>
A.    Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	34
B.    Metode Penelitian.....	34
C.    Variabel Operasionalisasi Penelitian.....	35
1.    Variabel Terikat (Dependent Variable).....	35
2.    Variabel Bebas ( <i>Independent Variable</i> ).....	37
D.    Metode Pengumpulan Data .....	40
E.    Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	41

F. Metode Analisis Data .....	44
1. Statistik Deskriptif .....	44
2. Analisis Model Regresi Data Panel.....	44
3. Uji Asumsi Klasik.....	47
4. Pengujian Hipotesis.....	48
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>50</b>
A. Statistik Deskriptif.....	50
B. Uji <i>Outlier</i> .....	54
C. Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	56
D. Uji Multikolinearitas .....	58
E. Hasil Regresi Data Panel menggunakan <i>Fixed Effect Model</i> dan Pembahasan.....	59
F. Hasil Uji Hipotesis .....	61
G. Koefisien Determinasi .....	64
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>66</b>
A. Kesimpulan.....	66
B. Implikasi .....	67
C. Saran.....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>69</b>
<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN .....</b>	<b>72</b>