

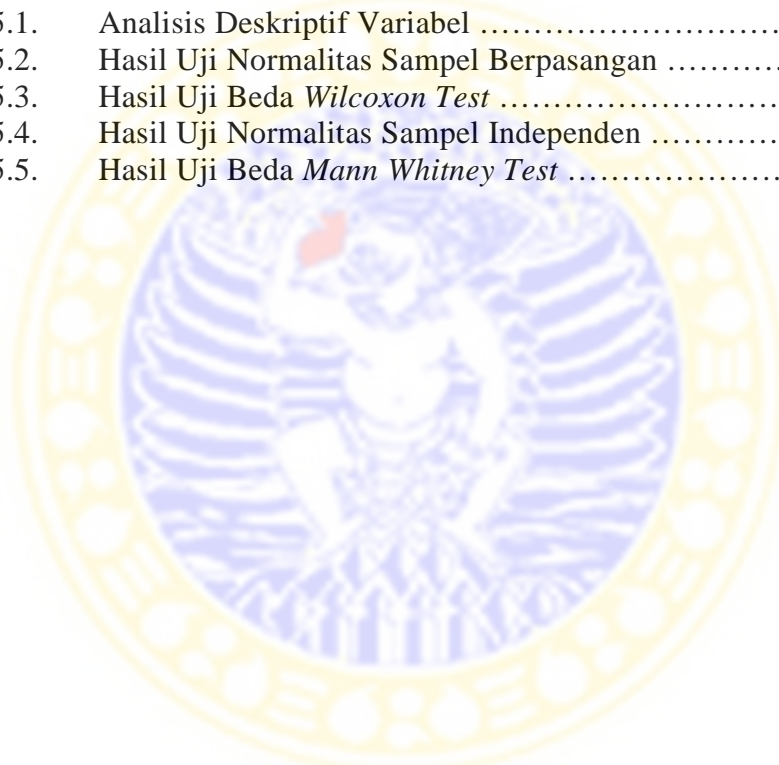
## DAFTAR ISI

Halaman Judul .....	i
Halaman Pernyataan .....	ii
Halaman Pengesahan .....	iii
Halaman Pernyataan Telah Diuji .....	iv
Kata Pengantar .....	v
Daftar Isi .....	viii
Daftar Tabel .....	x
Daftar Gambar .....	xi
Daftar Lampiran .....	xii
Abstrak .....	xiii
Abstract .....	xiv
<b>BAB 1.</b>	<b>PENDAHULUAN</b>
1.1	Latar Belakang ..... 1
1.2	Rumusan Masalah ..... 6
1.3	Tujuan Penelitian ..... 7
1.4	Manfaat Penelitian ..... 8
1.5	Sistematika Penelitian ..... 8
<b>BAB 2.</b>	<b>LANDASAN TEORI</b>
2.1	Tinjauan Pustaka ..... 10
2.1.1	Likuiditas ..... 10
2.1.2	Fraksi Harga ..... 13
2.1.3	<i>Bid-Ask Spead</i> ..... 14
2.1.4	<i>Depth</i> ..... 16
2.1.5	Satuan Perdagangan ..... 17
2.1.6	Volume Perdagangan Saham ..... 17
2.1.7	<i>Margin Trading</i> ..... 18
2.1.8	Teori Struktur Mikro Pasar ..... 18
2.1.9	Penelitian Terdahulu ..... 19
2.2	Hipotesis ..... 23
<b>BAB 3.</b>	<b>METODE PENELITIAN</b>
3.1	Desain Penelitian ..... 27
3.2	Definisi Operasional dan Variabel ..... 27
3.2.1	Bid-Ask Spread ..... 27
3.2.2	Depth ..... 28
3.2.3	Volume Perdagangan ..... 28
3.2.4	Periode Peristiwa ..... 29
3.3	Sampel Penelitian ..... 29
3.4	Metode Pengumpulan Data ..... 30

3.5	Teknik Analisis Data .....	30
<b>BAB 4.</b>	<b>GAMBARAN OBJEK PENELITIAN</b>	
4.1	Sejarah Singkat Bursa Efek Indonesia .....	33
4.2	Perubahan Fraksi Harga di BEI .....	34
4.3	Sampel Perusahaan .....	36
<b>BAB 5.</b>	<b>ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN</b>	
5.1	Statistik Deskriptif .....	39
5.2	Uji Normalitas Data Sampel Berpasangan ..	41
	5.2.1 Uji Beda t-test Dengan Sampel Berpasangan .....	43
5.3	Uji Normalitas Data Sampel Independen ...	45
	5.3.1 Uji Beda t-test Dengan Sampel Independen .....	46
5.4	Uji Hipotesis .....	48
<b>BAB 6.</b>	<b>KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
6.1	Kesimpulan .....	50
6.2	Keterbatasan Penelitian .....	51
6.3	Saran .....	52
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>		
<b>LAMPIRAN</b>		

**DAFTAR TABEL**

Tabel 1.1.	Data Perusahaan Delisted Tahun 2007-2013 .....	2
Tabel 1.2.	Perubahan Fraksi Harga di BEI .....	3
Tabel 1.3.	Perubahan Satuan Perdagangan dan Fraksi Harga di Bursa Efek Indonesia .....	4
Tabel 2.1.	Ringkasan Penelitian Terdahulu .....	22
Tabel 4.1.	Perubahan Fraksi Harga di BEI .....	34
Tabel 4.2.	Perubahan Satuan Perdagangan dan Fraksi Harga di Bursa Efek Indonesia .....	35
Tabel 5.1.	Analisis Deskriptif Variabel .....	39
Tabel 5.2.	Hasil Uji Normalitas Sampel Berpasangan .....	42
Tabel 5.3.	Hasil Uji Beda <i>Wilcoxon Test</i> .....	44
Tabel 5.4.	Hasil Uji Normalitas Sampel Independen .....	45
Tabel 5.5.	Hasil Uji Beda <i>Mann Whitney Test</i> .....	47



## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Kerangka Hipotesis .....	26
--------------------------------------	----



**DAFTAR LAMPIRAN**

- Lampiran 1 : Statistik Deskriptif *Bid-Ask Spread*.  
Lampiran 2 : Statistik Deskriptif *Ask Depth*.  
Lampiran 3 : Statistik Deskriptif *Bid Depth*.  
Lampiran 4 : Statistik Deskriptif Volume Perdagangan.  
Lampiran 5 : Uji Normalitas Saham *margin* dan Saham *non-margin* sebelum *event*.  
Lampiran 6 : Uji Normalitas Saham *margin* dan Saham *non-margin* sesudah *event*.  
Lampiran 7 : Uji Normalitas Saham *margin* sebelum *event*.  
Lampiran 8 : Uji Normalitas Saham *margin* sesudah *event*.  
Lampiran 9 : Uji Normalitas Saham *non-margin* sebelum *event*.  
Lampiran 10 : Uji Normalitas Saham *non-margin* sesudah *event*.  
Lampiran 11 : Uji Beda *Wilcoxon Test (Paired t-test Non Parametrik)*.  
Lampiran 12 : Uji Beda *Mann Whitney Test*.

