

## DAFTAR ISI

Halaman Pengesahan .....	ii
Halaman Pernyataan Keaslian Karya Tulis.....	iii
Kata Pengantar .....	iv
Daftar Isi .....	vi
Daftar Tabel .....	viii
Daftar Gambar .....	ix
Daftar Lampiran.....	x
Intisari .....	xi
<i>Abstract</i> .....	xii
<b>BAB I. PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1. 1 Latar Belakang .....	1
1. 2 Rumusan Masalah .....	5
1. 3 Pertanyaan Penelitian .....	7
1. 4 Tujuan Penelitian .....	7
1. 5 Kontribusi Penelitian .....	7
1. 6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian .....	9
1. 7 Sistematika Penulisan .....	10
<b>BAB II. LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>12</b>
2. 1 Behavioral Finance Theory .....	12
2. 1. 1 <i>Limits to arbitrage</i> .....	16
2. 1. 2 Psikologi.....	19
2. 2 Sentimen Investor .....	20
2. 2. 1 Pendekatan pengukuran sentimen .....	23
2. 3 Aliran Modal Asing .....	25
2. 4 Volatilitas Pasar Saham .....	26
2. 5 Penelitian Terdahulu .....	28
2. 6 Pengembangan Model Penelitian .....	33
2. 7 Pengembangan Hipotesis .....	37
<b>BAB III. METODE PENELITIAN.....</b>	<b>40</b>
3. 1 Desain Penelitian .....	40
3. 2 Populasi dan Sampel .....	40
3. 3 Data dan Sumber Data .....	41

3. 4	Teknik Pengumpulan Data .....	41
3. 5	Definisi Operasional Variabel.....	42
3. 5. 1	Variabel Dependen .....	42
3. 5. 2	Variabel Independen .....	43
3. 6	Model Penelitian .....	47
3. 7	Teknik Analisis Data .....	47
<b>BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>		<b>52</b>
4. 1	Deskripsi Data .....	52
4. 2	Statistik Deskriptif .....	56
4. 3	Uji Stasioneritas Data .....	58
4. 4	Uji Asumsi Klasik.....	59
4. 4. 1	Uji Normalitas .....	59
4. 4. 2	Uji Multikolinearitas .....	60
4. 4. 3	Uji Heteroskedastisitas .....	61
4. 4. 4	Uji Autokorelasi .....	62
4. 5	Uji Statistik t .....	63
4. 6	Uji Statistik F.....	66
4. 7	Pembahasan .....	67
4. 7. 1	Sentimen Investor Berpengaruh Positif Terhadap Volatilitas Pasar Saham .....	67
4. 7. 2	Aliran Modal Asing Berpengaruh Positif Terhadap Volatilitas Pasar Saham .....	69
<b>BAB V. KESIMPULAN.....</b>		<b>72</b>
5. 1	Kesimpulan .....	72
5. 2	Keterbatasan Penelitian.....	72
5. 3	Implikasi .....	73
5. 3. 1	Implikasi Praktis .....	73
5. 3. 2	Implikasi Teoritis .....	74
Daftar Pustaka.....		75