

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR GRAFIK.....	vii
DAFTAR TABEL.....	viii
INTISARI.....	ix
ABSTRACT.....	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penulisan.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Landasan Teoritis	9
2.1.1 Pasar Modal	9
2.1.2 Indeks Saham.....	10
2.1.3 Efisiensi Pasar (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	11
2.1.4 <i>Price limit</i>	12
2.1.5 Volatilitas.....	13
2.2 Penelitian Terdahulu.....	14
BAB III METODE PENELITIAN.....	18
3.1 Populasi dan Sampel	18
3.2 Variabel dan Definisi Operasi	19
3.2.1 Volatilitas.....	19
3.3 Teknik Analisa Data	20
3.3.1 Pengujian Hipotesis	21
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	24
4.1 Deskriptif Sampel.....	24

4.2 Analisis Perbedaan Volatilitas Saham LQ45 Rezim <i>Symmetric Auto-Rejection</i> dan Rezim <i>Asymmetric Auto-Rejection</i>	24
4.3 Analisis Perbedaan Volatilitas Saham LQ45 Sebelum dan Setelah <i>Auto-Rejection</i> Bawah Rezim <i>Asymmetric Auto-Rejection</i>	27
4.4 Analisis Perbedaan Volatilitas Saham LQ45 Sebelum dan Setelah <i>Auto-Reject</i> Bawah Rezim <i>Symmetric Auto Rejection</i>	29
BAB V KESIMPULAN	32
5.1 Kesimpulan.....	32
5.2 Keterbatasan	33
5.3 Saran	33
5.4 Implikasi	34
DAFTAR PUSTAKA	35