

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Pengesahan.....	ii
Lembar Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	v
Daftar Tabel.....	vi
Daftar Gambar.....	vii
Daftar Lampiran.....	viii
Intisari.....	ix
Abstrak.....	x
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Motivasi Penelitian.....	8
1.3 Rumusan Masalah	9
1.4 Pertanyaan Penelitian	10
1.5 Tujuan Penelitian.....	10
1.6 Manfaat Penelitian.....	11
1.7 Sistematika Penulisan.....	11
 BAB II LANDASAN TEORI	 13
2.1 Pasar Modal Indonesia	13
2.2 Volatilitas Harga Saham	14
2.3 Investor Institusi Asing	15
2.4 Indeks Saham dan Papan Perdagangan Saham	20
2.5 Penelitian Terdahulu.....	22
2.6 Kerangka Penelitian	24
2.7 Hipotesis Penelitian.....	26

BAB III METODE PENELITIAN	27
3.1 Desain Penelitian	27
3.2 Sampel	27
3.3 Definisi Operasional Variabel.....	28
3.3.1 Variabel Independen.....	28
3.3.2 Variabel Dependen	30
3.3.3 Variabel Kendali	30
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	32
3.5 Teknik Analisis Data	33
3.5.1 Statistik Deskriptif	33
3.5.2 Model Analisis Data.....	33
3.5.3 Penentuan Model Analisis Data	35
3.5.4 Uji Asumsi Klasik	37
 BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	 43
4.1 Deskripsi Data	43
4.1.1 Objek Penelitian	43
4.2 Hasil Analisis.....	44
4.2.1 Hasil Statistik Deskriptif.....	44
4.2.2 Uji Penentuan Model.....	46
4.2.3 Uji Asumsi Klasik	53
4.2.4 Pengujian Hipotesis.....	56
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	61
4.3.1 Pengaruh nilai transaksi saham oleh investor institusi asing terhadap volatilitas harga saham indeks LQ45 (H_1) dan Papan Akselerasi Bursa (H_3).....	61
4.3.2 Pengaruh frekuensi transaksi saham oleh investor institusi asing terhadap volatilitas harga saham indeks LQ45 (H_2) dan Papan Akselerasi Bursa (H_4).....	62
4.3.3 Pengaruh ukuran saham dan likuiditas saham terhadap volatilitas harga saham.....	64

BAB V SIMPULAN DAN SARAN	65
5.1 Simpulan.....	65
5.2 Keterbatasan	66
5.3 Implikasi Praktis.....	66
 DAFTAR PUSTAKA.....	 69
DAFTAR LAMPIRAN	73