

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL	x
ABSTRAK	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Pertanyaan Penelitian	6
1.4. Tujuan Penelitian	6
1.5. Manfaat Penelitian	6
1.6. Lingkup Penelitian	6
1.7. Sistematika Penelitian	7
BAB II	9
LANDASAN TEORI	9
2.1. Pasar Modal	9
2.2. Volume Perdagangan Saham	13
2.3. Volume Perdagangan Saham Oleh Investor Asing	14
2.4. Tingkat Bunga JIBOR	15

2.5.	Kurs Valuta Asing.....	15
2.6.	Indeks Harga Saham Gabungan	18
2.7.	Kerangka Penelitian	20
2.8.	Hipotesis Penelitian.....	20
2.9.	Literatur Terdahulu.....	21
BAB III		23
METODE PENELITIAN.....		23
3.1.	Desain Penelitian.....	23
3.2.	Periode Penelitian.....	23
3.3.	Variabel Penelitian.....	25
3.4.	Metode Analisis Data	25
3.4.1.	Statistik Deskriptif	26
3.4.2.	Uji Asumsi Klasik.....	26
3.4.3.	Uji Normalitas.....	26
3.4.4.	Uji Multikolinearitas	27
3.4.5.	Uji Heteroskedastisitas.....	27
3.4.6.	Uji Autokorelasi	27
3.4.7.	Regresi Linear Berganda.....	27
BAB IV		30
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		30
4.1.	Deskripsi Data	30
4.2.	Pembahasan.....	30
4.2.1.	Analisa Statistik Deskriptif.....	30
4.3.	Analisis Data	31
4.3.1.	Uji Multikolinearitas.....	31

4.3.2.	Uji Heteroskedastisitas.....	32
4.3.3.	Uji Normalitas.....	32
4.3.4.	Uji Autokorelasi	33
4.3.5.	Uji Hipotesis	33
4.4.	Ringkasan Hasil Penelitian.....	61
4.4.1.	JIBOR berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing	61
4.4.2.	Kurs Valuta Asing berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing	63
4.4.3.	IHSG berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing	64
BAB V	67
KESIMPULAN DAN SARAN.....		67
5.1.	Kesimpulan.....	67
5.2.	Implikasi.....	68
5.3.	Keterbatasan	68
5.4.	Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....		70
LAMPIRAN.....		72

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Indeks Kinerja Saham di Beberapa Bursa Saham Regional	2
Gambar 2.1 Skema Perdagangan Pasar Perdana	11
Gambar 2.2 Skema Transaksi Pasar Sekunder	13
Gambar 2.3 Kerangka Penelitian	20

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Perkembangan Perdagangan Saham oleh Pemodal Asing dan Domestik	2
Tabel 2.1 Kajian Penelitian Terdahulu	21
Tabel 4.1 Analisa Deskriptif	30
Tabel 4.2 Hasil Uji Multikolinearitas	32
Tabel 4.3 Hasil Uji Heteroskedastisitas	32
Tabel 4.4 Hasil Uji Normalitas	33
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi	33
Tabel 4.6 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2018-31 Desember 2019	34
Tabel 4.7 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021	35
Tabel 4.8 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024	36
Tabel 4.9 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 di Lag 1	38
Tabel 4.10 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 di Lag 1	39
Tabel 4.11 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 di Lag 1	40
Tabel 4.12 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 Bullish	42
Tabel 4.13 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	
Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 Bearish	43
Tabel 4.14 Hasil Uji Regresi Linier Berganda n	

Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 Bullish	44
Tabel 4.15 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 Bearish	45
Tabel 4.16 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 Bullish	46
Tabel 4.17 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 Bearish	48
Tabel 4.18 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 Lag1 Bullish	49
Tabel 4.19 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 Lag1 Bearish	50
Tabel 4.20 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 Lag1 Bullish	51
Tabel 4.21 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 Lag1 Bearish	53
Tabel 4.22 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 Lag1 Bullish	54
Tabel 4.23 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 Lag1 Bearish	55
Tabel 4.24 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2018 – 31 Desember 2019 + Dummy	56
Tabel 4.25 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2020-31 Desember 2021 + Dummy	58
Tabel 4.26 Hasil Uji Regresi Linier Berganda Periode 1 Januari 2022-30 Agustus 2024 + Dummy	59

Tabel 4.27 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis JIBOR Berpengaruh pada Total

Volume Perdagangan Asing Periode 2018-2019	61
Tabel 4.28 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis JIBOR Berpengaruh pada Total	
Volume Perdagangan Asing Periode 2020-2021	61
Tabel 4.29 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis JIBOR Berpengaruh pada Total	
Volume Perdagangan Asing Periode 2022-2024	61
Tabel 4.30 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis Kurs Valuta Asing Berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing Periode 2018-2019.....	
	62
Tabel 4.31 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis Kurs Valuta Asing Berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing Periode 2020-2021.....	
	62
Tabel 4.32 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis Kurs Valuta Asing Berpengaruh pada Total Volume Perdagangan Asing Periode 2022-2024	
	63
Tabel 4.33 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis IHSG Berpengaruh pada Total	
Volume Perdagangan Asing Periode 2018-2019	63
Tabel 4.34 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis IHSG Berpengaruh pada Total	
Volume Perdagangan Asing Periode 2020-2021	64
Tabel 4.35 Ringkasan Hasil Pengujian Hipotesis IHSG Berpengaruh pada Total	
Volume Perdagangan Asing Periode 2022-2024	64