

DAFTAR ISI

Lembar Judul.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Lampiran	x
Abstrak	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	3
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	6
2.1 <i>Market Microstructure</i>	6
2.2 <i>Full Call Auction (FCA)</i>	8
2.3 Volatilitas Harga Saham.....	10
2.4 <i>Price Discovery</i> Saham.....	11
2.5 Manipulasi Harga Saham	13
2.6 Pengembangan Hipotesis	15
2.6.1 Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	15
2.6.2 Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham.....	17
2.6.3 Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatilitas Harga Saham dengan Moderasi Manipulasi Harga Saham.....	19

2.6.4	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham dengan Moderasi Manipulasi Harga Saham.....	21
BAB III METODA PENELITIAN		24
3.1	Populasi dan Sampel	24
3.2	Data dan Sumber Data	24
3.3	Model Empiris	25
3.3.1	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	25
3.3.2	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham.....	26
3.4	Definisi Operasional Variabel	27
3.4.1	Perlakuan <i>Full Call Auction</i> (FCA)	27
3.4.2	Volatilitas harga saham.....	27
3.4.3	<i>Price Discovery Saham</i> (PDS).....	30
3.4.4	Manipulasi harga saham.....	31
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		34
4.1	Deskripsi Data.....	34
4.1.1	Hasil Pengumpulan Data.....	34
4.1.2	Statistik Deskriptif	35
4.2	Pengujian Hipotesis	38
4.2.1	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	38
4.2.2	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham.....	39
4.3	Pembahasan.....	41
4.3.1	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	41
4.3.2	Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham.....	43

4.3.3	Moderasi Manipulasi Harga Saham pada Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap Volatiliias Harga Saham	45
4.3.4	Moderasi Manipulasi Harga Saham pada Pengaruh Perlakuan <i>Full Call Auction</i> terhadap <i>Price Discovery</i> Saham	46
BAB V SIMPULAN		48
5.1	Simpulan	48
5.2	Keterbatasan.....	49
5.3	Implikasi	50
Daftar Pustaka		51
Lampiran		54