

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xiii
Daftar Gambar	xix
Daftar Lampiran	xxi
Intisari	xxii
Abstract	xxiii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	6
1.3 Keaslian Penelitian	7
1.4 Manfaat yang diharapkan	8
1.5 Tujuan Penelitian	9
1.6 Sistematika Penulisan	10

BAB II LANDASAN TEORI

2.1	Pasar Modal	11
2.1.1	Bursa Efek	13
2.1.2	Saham	14
2.1.3	Pasar Modal di Indonesia	15
2.2	Kepemilikan Asing (<i>Foreign Ownership</i>)	18
2.3	Penelitian yang berhubungan	24

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Bahan atau Materi Penelitian	29
3.2	Variabel Penelitian	30
3.3	Objek Penelitian	32
3.4	Metode Analisis Data	36
3.4.1	Uji Kausalitas Granger	36
3.4.2	Uji Kointegrasi	36
3.4.3	Analisis Regresi linier	38
3.4.4	Uji Asumsi Klasik	39
3.4.5	<i>Analisis of Variance</i> (ANOVA)	42
3.4.6	<i>Independent Sample t-Test</i>	42

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Analisis Perbedaan Tingkat Kepemilikan Saham oleh Investor Asing.....	44
4.2 Analisis Pengaruh Tingkat Kepemilikan Investor Asing terhadap <i>Return Saham</i>	47
4.2.1 Analisis terhadap <i>Return Saham</i> secara Keseluruhan Di BEI	48
4.2.2 Analisis terhadap <i>Return Saham-saham</i> Berkapitalisasi Pasar Besar	54
4.2.3 Analisis terhadap <i>Return Saham-saham</i> Berkapitalisasi Pasar Menengah	61
4.2.4 Analisis terhadap <i>Return Saham-saham</i> Berkapitalisasi Pasar Kecil	67
4.3 Analisis Pengaruh Tingkat Kepemilikan Investor Asing terhadap Volume Perdagangan Saham	73
4.3.1 Analisis terhadap Volume Perdagangan Saham secara Keseluruhan di BEI	73
4.3.2 Analisis terhadap Volume Perdagangan Saham-saham Berkapitalisasi Pasar Besar	79
4.3.3 Analisis terhadap Volume Perdagangan Saham-saham Berkapitalisasi Pasar Menengah	85
4.3.4 Analisis terhadap Volume Perdagangan Saham-saham Berkapitalisasi Pasar Kecil	91

BAB V KESIMPULAN, SARAN DAN IMPLIKASI

5.1 Kesimpulan	98
5.2 Saran	101
5.3 Implikasi	101

Daftar Pustaka	xxiv
-----------------------------	------

Lampiran