

DAFTAR ISI

COVER	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR GRAFIK	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Tujuan Penelitian	5
1.4. Manfaat Penelitian	5
1.5. Batasan Penelitian	5
1.6. Sistematika Penulisan	6
BAB II. LANDASAN TEORI DAN PERUMUSAN HIPOTESIS.....	7
2.1. Landasan Teori	7
2.1.1. Sentimen	7

2.1.2. <i>Return</i>	12
2.1.3. <i>Volatility</i>	13
2.2. Kerangka Pikir dan Hipotesis Penelitian	15
2.2.1. Kerangka Pikir	15
2.2.2. Hipotesis Penelitian	15
BAB III. METODE PENELITIAN	18
3.1. Populasi dan Sampel	18
3.2. Jenis dan Sumber Data	18
3.3. Variabel Penelitian	18
3.4. Metode Analisis Data	20
3.4.1. Analisis Statistik Deskriptif	20
3.4.2. Analisis <i>Vector Autoregression (VAR)</i>	20
BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	25
4.1. Hasil Penelitian	25
4.1.1. Deskripsi Variabel Penelitian	25
4.1.2. Data Variabel	26
4.1.2.1. Deskripsi Variabel Volume Perdagangan Saham	26
4.1.2.2. Deskripsi Variabel <i>Return</i>	26
4.1.2.3. Deskripsi Variabel <i>Volatility</i>	27
4.2. Hasil Uji Permodelan	27
4.2.1. Uji Akar Unit	27
4.2.2. Pemilihan <i>Lag Optimal</i>	28

4.2.3. Uji Kointegrasi	29
4.2.4. Uji Granger Kausalitas	30
4.2.5. Estimasi <i>Vector Autoregression</i> (VAR)	32
4.3. Pembahasan	35
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	38
5.1. Kesimpulan	38
5.2. Implikasi	38
5.3. Keterbatasan Penelitian	39
5.4. Saran	39
DAFTAR PUSTAKA	41
LAMPIRAN	44

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1. Pengukuran Sentimen	8
Tabel 4.1. Deskripsi Statistik Variabel Penelitian	25
Tabel 4.2. Hasil Uji Akar Unit	28
Tabel 4.3. Pemilihan Lag Optimal	29
Tabel 4.4. Uji <i>Johansen</i>	30
Tabel 4.5. Uji Granger Kausalitas	31
Tabel 4.6. Persamaan 1	32
Tabel 4.7. Persamaan 2	34

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Poin Kenaikan/Penurunan IHSG	3
Gambar 2.1. Kerangka Pikir Penelitian	15

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1. Perkembangan Variabel Volume Perdagangan Saham	26
Grafik 4.2. Perkembangan Variabel <i>Return</i>	26
Grafik 4.3. Perkembangan Variabel <i>Volatility</i>	27

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Uji Akar Unit	44
Lampiran 2. Uji <i>Lag</i> Optimal	46
Lampiran 3. Uji Kointegrasi <i>Johansen</i>	47
Lampiran 4. Uji Kausalitas	49
Lampiran 5. Estimasi VAR	50
Lampiran 6. Data Variabel	52