



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Motivasi Penelitian	8
1.6 Sistematika Penulisan	8
BAB II	10
2.1 <i>Circuit Breaker</i>	10
2.2 <i>Price Limit</i>	11
2.3 <i>Price Limit</i> di BEI.....	12
2.4 <i>Price limit</i> dan Volatilitas	16
2.4.1 <i>Volatility Spillover Hypothesis</i>	18
2.5 <i>Price Limit</i> dan <i>Trading Activity</i>	20
2.5.1 <i>Trading Interference Hypothesis</i>	21
BAB III	23
3.1 Data dan Sampel	23
3.2 Definisi Operasional	32
3.3 Teknik Analisis Data.....	34
BAB IV	38
4.1 Deskripsi Data.....	38
4.2 Pengujian Volatiltias pada <i>Price Limit</i> Atas	41
4.3 <i>Trading Interference</i> pada <i>Price Limit</i> Atas	44
4.4 Pengujian Volatilitas pada <i>Price Limit</i> Bawah	46
4.5 <i>Trading Interference</i> pada <i>Price Limit</i> Bawah.....	48
BAB V	51



5.1	Kesimpulan	51
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	52
5.3	Saran untuk Penelitian Selanjutnya.....	52
5.4	Implikasi	53
DAFTAR PUSTAKA.....		54
LAMPIRAN.....		56