

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAKSI.....	viii
KATA PENGANTAR.....	x
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL.....	xviii
DAFTAR GAMBAR.....	xx
DAFTAR LAMPIRAN.....	xxi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	16
1.3 Tujuan Penelitian.....	21
1.4 Kegunaan Penelitian.....	21
1.5 Sistematika Penelitian.....	22
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	25

2.1 Definisi.....	25
2.1.1 Trend Media Sosial.....	25
2.1.2 Volume Perdagangan Saham.....	26
2.1.3 Return Saham.....	27
2.1.4 Risiko Saham.....	28
2.1.5 Hipotesis Pasar Efisien.....	29
2.1.6 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	32
2.2 Penelitian Terdahulu.....	34
2.3 Pengaruh Antar Variabel.....	42
2.3.1 Terdapat Hubungan Antara Trend Media Sosial Terhadap Return Saham, Volume Perdagangan Saham, dan Risiko Saham Secara Simultan.....	43
2.3.2 Terdapat Hubungan Antara Volume Perdagangan Saham Terhadap Risiko Saham.....	44
2.3.3 Terdapat Hubungan Antara Return Saham Terhadap Risiko Saham.....	45
2.3.4 Terdapat Hubungan Antara Return Saham Terhadap Volume Perdagangan Saham.....	45
2.3.5 Terdapat Hubungan Antara Risiko Saham Terhadap Volume Perdagangan.....	46
2.3.6 Terdapat Hubungan Antara Risiko Saham Terhadap Return Saham.....	46

2.3.7 Terdapat Hubungan Antara Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham.....	47
2.3.8 Terdapat Pengaruh <i>Shock</i> dari Trend Media Sosial Terhadap Variabel-Variabel Endogen.....	47
2.3.9 Kontribusi Perubahan dari Satu Variabel Endogen yang Terbesar Akibat Adanya <i>Shock</i> Berasal dari Variabel Itu Sendiri.....	48
2.4 Kerangka Pemikiran.....	49
BAB III METODE PENELITIAN.....	50
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	50
3.1.1 Variabel Penelitian.....	50
3.1.2 Definisi Operasional.....	50
3.1.2.1 Trend Media Sosial.....	50
3.1.2.2 Return Saham.....	51
3.1.2.3 Volume Perdagangan Saham.....	52
3.1.2.4 Risiko Saham.....	52
3.2 Populasi dan Sampel.....	54
3.2.1 Populasi.....	54
3.2.2 Sampel.....	54
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	55
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	56
3.5 Metode Analisis Data.....	56

3.6 Analisis Inferensial.....	57
3.6.1 Uji Stasioneritas.....	57
3.5.2 Uji <i>Lag</i> Optimal.....	57
3.5.3 Uji Kausalitas <i>Granger</i>	58
3.6.4 Model VAR dan VAR-X.....	59
3.6.5 <i>Impulse Response Function</i>	60
3.6.6 <i>Variance Decomposition</i>	61
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....	63
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	63
4.2 Analisis Data.....	64
4.2.1 Uji Stasioneritas.....	64
4.2.2 Uji <i>Lag</i> Optimal.....	66
4.2.3 Uji Kausalitas <i>Granger</i>	68
4.2.4 Model VAR-X.....	80
4.2.5 <i>Impulse Response Function</i>	85
4.2.6 <i>Variance Decomposition</i>	89
4.3 Pembahasan.....	98
4.3.1 Terdapat Hubungan Antara Trend Media Sosial Terhadap Return Saham Harian, Volume Perdagangan Saham, dan Risiko Saham Secara Simultan.....	100
4.3.2 Terdapat Hubungan Antara Volume Perdagangan Saham Terhadap Risiko Saham.....	102

4.3.3 Terdapat Hubungan Antara Return Saham Terhadap Risiko Saham.....	102
4.3.4 Terdapat Hubungan Antara Return Saham Terhadap Volume Peerdagangan Saham.....	103
4.3.5 Terdapat Hubungan Antara Risiko Saham Terhadap Volume Perdagangan.....	104
4.3.6 Terdapat Hubungan Antara Risiko Saham Terhadap Return Saham.....	105
4.3.7 Terdapat Hubungan Antara Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham.....	105
4.3.8 Terdapat Pengaruh <i>Shock</i> dari Trend Media Sosial Terhadap Variabel-Variabel Endogen.....	106
4.3.9 Kontribusi Perubahan dari Satu Variabel Endogen yang Terbesar Akibat Adanya <i>Shock</i> Berasal dari Variabel Itu Sendiri.....	110
 BAB V PENUTUP.....	112
5.1 Simpulan.....	112
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	116
5.3 Saran.....	117
5.3.1 Saran untuk Penelitian Selanjutnya.....	117
5.3.2 Saran untuk Investor.....	117
 DAFTAR PUSTAKA.....	119