

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRAK.....	vi
<i>ABSTRACT</i>	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	15
1.3 Tujuan Penelitian	16
1.5 Sistematika Penulisan	17
BAB II.....	19
TINJAUAN PUSTAKA	19
2.1 Landasan Teori.....	19
2.1.1 <i>Signalling Theory</i> (Teori Signal)	19
2.1.2 <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH)	20
2.1.3 Teori Keagenan	22
2.1.4 Pasar Modal	24
2.1.5 Harga Saham	27
2.1.6 Return Saham.....	29

2.1.7 Volatilitas Harga Saham	30
2.1.8 Kepemilikan Saham Asing	32
2.1.9 Kepemilikan Saham Intitusional	34
2.1.10 Volume Perdagangan	35
2.1.11 Frekuensi Perdagangan	35
2.1.12 <i>Order Imbalance</i>	36
2.2 Penelitian Terdahulu	37
2.3 Pengaruh Variabel Independen terhadap Variabel Dependen dan Perumusan Hipotesis	49
2.3.1 Pengaruh Kepemilikan Saham Asing terhadap Volatilitas Harga Saham	49
2.3.2 Pengaruh Kepemilikan saham institusional terhadap Volatilitas Harga Saham.....	50
2.3.3 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham.....	51
2.3.4 Pengaruh Frekuensi Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham ..	52
2.3.5 Pengaruh Order Imbalance terhadap Volatilitas Harga Saham	53
2.4 Kerangka Pemikiran.....	54
2.5 Hipotesis	55
BAB III	53
METODE PENELITIAN.....	53
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	53
3.1.1 Variabel Penelitian	53
3.1.2 Definisi Operasional	54
3.2.1 Populasi.....	59
3.2.2 Sampel.....	60
3.3 Jenis dan Sumber data.....	61
3.5 Metode Analisis	62
3.5.1 Statistik Deskriptif	62
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	62
3.5.3 Analisis Regresi Linier Berganda	65
3.5.4 Uji Hipotesis	66

BAB IV	100
HASIL DAN PEMBAHASAN.....	100
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	100
4.2 Analisis Data	101
4.2.1 Statistik Deskriptif	101
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	104
4.2.3 Uji Hipotesis	113
4.3 Interpretasi Hasil	119
4.3.1 Pengaruh Kepemilikan Saham Asing terhadap Volatilitas Harga Saham	119
4.3.2 Pengaruh Kepemilikan Saham Institusional terhadap Volatilitas Harga Saham.....	121
4.3.3 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham...	123
4.3.4 Pengaruh Frekuensi Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham	125
4.3.5 Pengaruh <i>Order Imbalance</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	126
BAB V	129
PENUTUP.....	129
5.1 Kesimpulan	129
5.2 Keterbatasan.....	131
5.3 Saran	131
DAFTAR PUSTAKA	134
LAMPIRAN.....	139
LAMPIRAN A Daftar Perusahaan Sampel Penelitian	139
LAMPIRAN B Data Penelitian	145
LAMPIRAN C Hasil Output SPSS.....	170