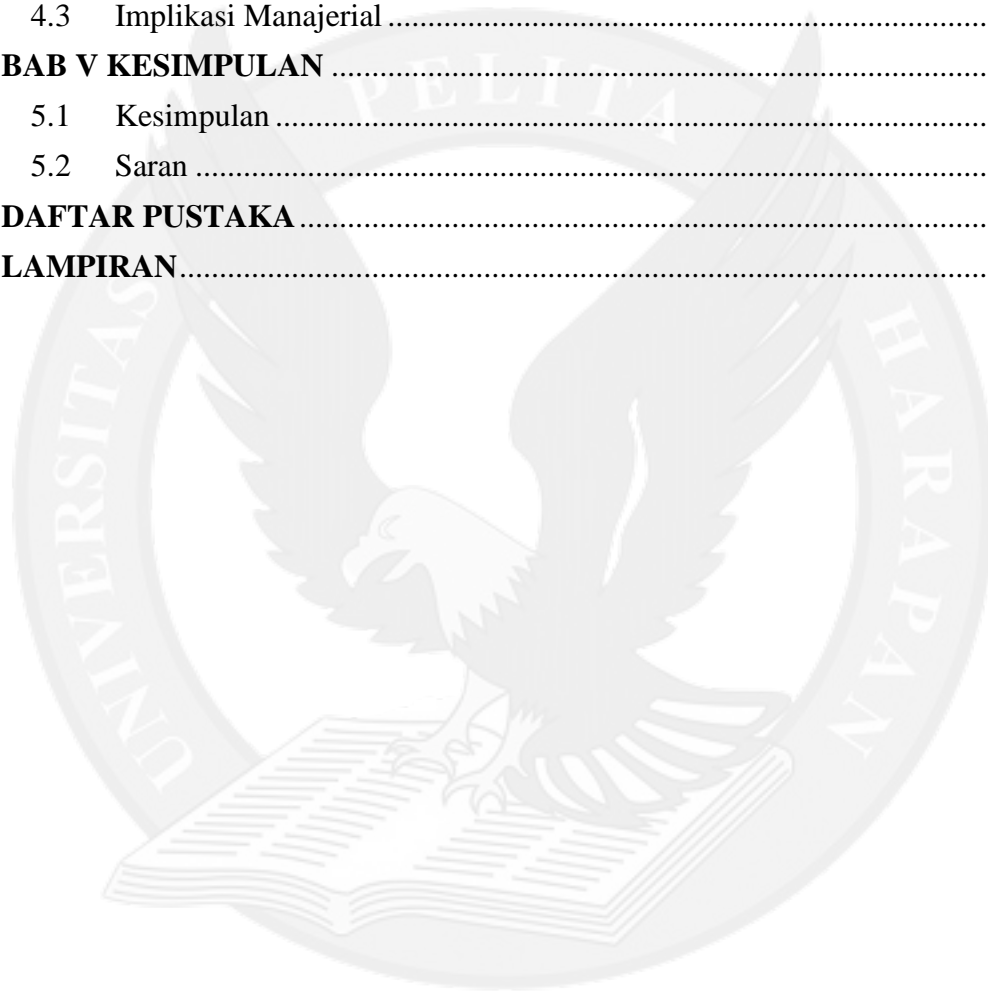


DAFTAR ISI

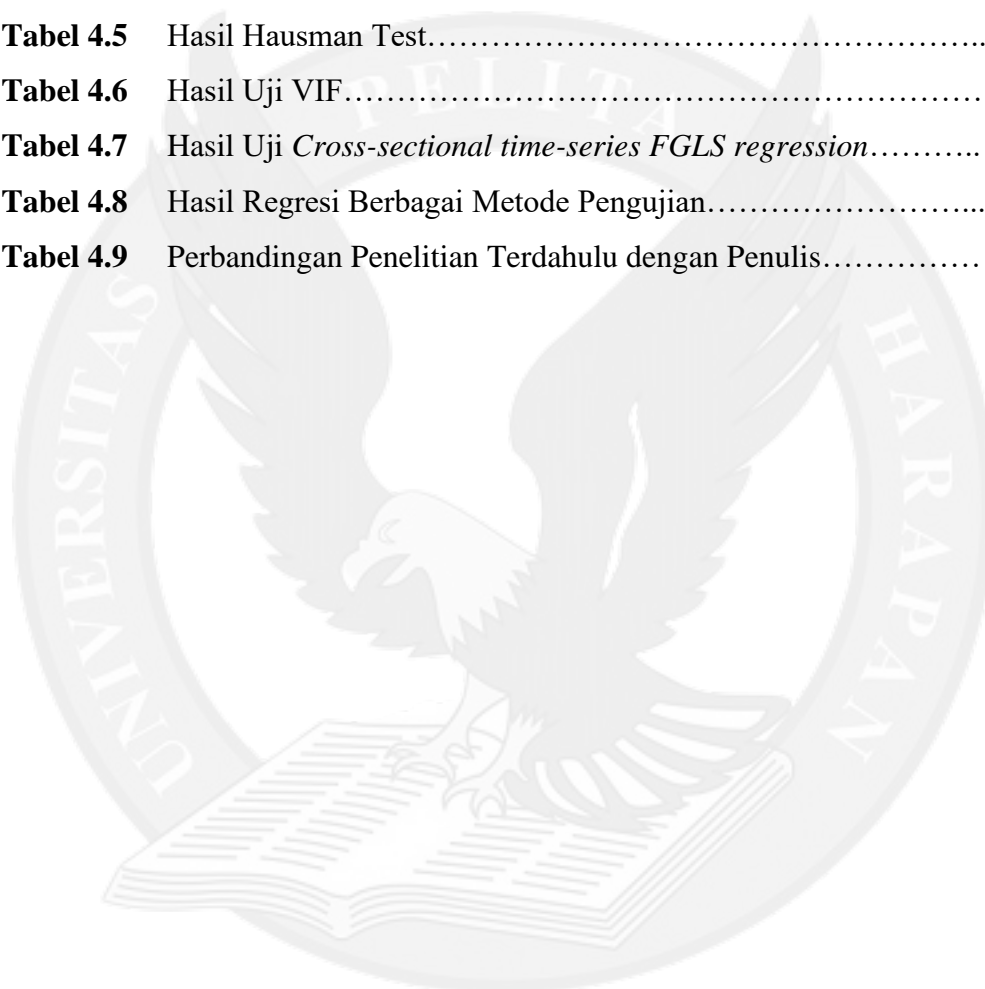
LEMBAR JUDUL TUGAS AKHIR TESIS	i
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR	ii
LEMBAR PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR.....	iii
LEMBAR PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Masalah Penelitian	7
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Batasan Penelitian.....	8
1.6 Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1 Perilaku Investor	10
2.2 Volatilitas Harga Saham	11
2.3 Kapitalisasi Pasar dan Volatilitas Harga Saham	12
2.4 Turnover dan Volatilitas Harga Saham.....	12
2.5 Leverage dan Volatilitas Harga Saham.....	12
2.6 Market to Book dan Volatilitas Harga Saham	13
2.7 Investor Institusi Asing dan Volatilitas Harga Saham	13
2.8 Investor Institusi Asing dan Volatilitas Harga Saham Pada Saat Krisis..	18
2.9 Penelitian Terdahulu	19
2.10 Pengembangan Hipotesis	21
2.11 Kerangka Pemikiran.....	22
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	24
3.1 Data	24
3.2 Model Empiris	25
3.3 Pengukuran Variabel.....	26
3.4 Proses Pengolahan Data.....	28

3.4.1	Regresi Data Panel	29
BAB IV	PEMBAHASAN.....	32
4.1	Analisis	35
4.1.1	Chow Test	35
4.1.2	LM Test.....	35
4.1.3	Hausman Test.....	35
4.1.4	Uji Asumsi Klasik.....	36
4.2	Pembahasan.....	37
4.3	Implikasi Manajerial	44
BAB V	KESIMPULAN	46
5.1	Kesimpulan	46
5.2	Saran	47
DAFTAR PUSTAKA		xiii
LAMPIRAN.....		xix



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu.....	20
Tabel 3.1	Syarat Sampel dan Total Observasi.....	25
Tabel 4.1	Matriks Korelasi.....	34
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	34
Tabel 4.3	Hasil Chow Test.....	35
Tabel 4.4	Hasil LM Test.....	35
Tabel 4.5	Hasil Hausman Test.....	36
Tabel 4.6	Hasil Uji VIF.....	36
Tabel 4.7	Hasil Uji <i>Cross-sectional time-series FGLS regression</i>	37
Tabel 4.8	Hasil Regresi Berbagai Metode Pengujian.....	38
Tabel 4.9	Perbandingan Penelitian Terdahulu dengan Penulis.....	41



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Kerangka Pemikiran	23
Gambar 4.1	Rata-rata Kepemilikan Saham Institusi Asing Tahun 2008 – 2021	32

