

DAFTAR ISI

HALAMN JUDUL	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI.....	xix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	7
1.5 Sistematika Skripsi	8
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 <i>Return</i> dan pengukurannya	10
2.1.2 Volatilitas <i>return</i> saham dan pengukurannya	11
2.1.3 Kepemilikan berdasarkan tipe investor dan pengukurannya	12
2.1.4 Faktor-faktor lain yang memengaruhi volatilitas <i>return</i> saham.....	16
2.2 Penelitian Terdahulu.....	19
2.3 Hipotesis dan Model Analisis.....	23
2.3.1 Hipotesis.....	23
2.3.2 Model Analisis	23
2.4 Kerangka Berfikir.....	25
BAB 3 METODE PENELITIAN.....	26
3.1 Pendekatan Penelitian.....	26
3.2 Identifikasi Variabel	26
3.3 Definisi Operasional Variabel	27

3.4	Jenis dan Sumber Data	28
3.5	Prosedur Penentuan Sampel	29
3.6	Prosedur Pengumpulan Data	29
3.7	Teknik Analisis.....	30
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN		34
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian	34
4.2	Deskripsi Hasil Penelitian	34
4.3	Pengujian Asumsi Klasik	36
4.4	Analisis Model dan Pengujian Hipotesis.....	39
4.5	Pembahasan	42
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN.....		48
5.1	Simpulan.....	48
5.2	Saran	49
DAFTAR PUSTAKA		50
LAMPIRAN.....		53

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Deskriptif Statistik Variabel Penelitian	35
Tabel 4.2 Hasil Uji Asumsi Klasik Model 1	37
Tabel 4.3 Hasil Uji Asumsi Klasik Model 2	37
Tabel 4.4 Hasil Output Regresi Model 1	39
Tabel 4.5 Hasil Output Regresi Model 2	39

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Nilai Transaksi Saham Harian pada BEI (Rp Miliar)	3
Gambar 1.2 Komposisi Kepemilikan Saham Investor Asing dan Domestik yang Terdaftar di KSEI.....	5
Gambar 2.1 Kerangka Berpikir	25
Gambar 4.1 Volume Perdagangan Investor Asing di Indonesia	43
Gambar 4.2 Komposisi Kepemilikan Investor Institusional Asing	44
Gambar 4.3 Komposisi Kepemilikan Investor Institusional Domestik	45
Gambar 4.4 Komposisi Kepemilikan Investor Individu Domestik.....	46