

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis perilaku *stealth trading* pada Perusahaan Konsumsi dan Makanan di Indeks LQ-45. Penelitian ini menggunakan data sekunder *Intraday* dari transaksi perdagangan saham Perusahaan Konsumsi dan Makanan di Indeks LQ-45 periode Maret, April, dan Mei 2017. Metode analisis data yang digunakan adalah metode deskriptif kuantitatif dengan jumlah 2 perusahaan. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa terdapatnya perilaku *stealth trading* pada investor asing. Hal tersebut ditunjukkan dari tingginya persentase perubahan harga, yang diikuti dengan persentase transaksi serta persentase volume yang tinggi yang terjadi pada ukuran menengah-kecil. Akan tetapi, tidak ditemukan adanya perilaku *stealth trading* yang dilakukan oleh investor domestik. Hal tersebut ditunjukkan dari tingginya persentase perubahan harga, yang diikuti dengan persentase transaksi serta persentase volume yang tinggi yang terjadi pada ukuran kecil.

Kata kunci: Perilaku *Stealth Trading*, Perusahaan Konsumsi dan Makanan, Indeks LQ-45