

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	v
HALAMAN PERNYATAAN ORISINILITAS.....	vii
ABSTRAK.....	ix
KATA PENGANTAR.....	xi
DAFTAR ISI	xiii
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR GAMBAR	xix
DAFTAR LAMPIRAN	xxi
<u>BAB 1</u> PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.3 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Manfaat Penelitian.....	11
1.4.1 Pemangku Kepentingan.....	11
1.4.2 Investor-Investor	11
1.4.3 Bagi Penulis.....	12
<u>BAB 2</u> KAJIAN PUSTAKA	13
2.1 Landasan Teori	13
2.1.1 Teori <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EHM).....	13
2.1.2 <i>Behavioral Finance</i>	14
2.1.3 Perilaku <i>Herding</i>	15
2.1.3.1 Penyebab Perilaku <i>Herding</i>	16
2.1.3.2 Dampak Perilaku <i>Herding</i>	17
2.1.4 <i>Penny Stock</i> atau Saham Gorengan.....	17
2.2 Metode Pendeteksi Perilaku <i>Herding</i>	20
2.3 Penelitian Terdahulu.....	22
2.4 Kerangka Pemikiran.....	24
2.5 Rumusan Masalah	25

<u>BAB 3</u> METODE PENELITIAN	27
3.1 Metode Penelitian	27
3.2 Jenis dan Sumber Data.....	27
3.2.1 Jenis Data.....	27
3.2.2 Metode Pengumpulan Data.....	28
3.3 Populasi dan Sampel.....	28
3.3.1 Populasi	28
3.3.2 Sampel	29
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	31
3.5 Variabel Penelitian	32
3.5.1 Variable Bebas / Independen	32
3.5.2 Variabel Terikat / Dependen	32
3.6 Definisi Operasional Variabel.....	32
3.6.1 <i>Return</i> Pasar.....	32
3.6.2 <i>Cross Sectional Absolute Deviation (CSAD)</i>	33
3.7 Metode Analisis Data.....	35
3.7.1 Menghitungnya <i>Return</i> Saham	35
3.7.2 Menghitung Nilai <i>Return</i> Pasar	35
3.7.3 <i>Cross Sectional Absolute Deviation (CSAD)</i>	35
3.8 Analisis Statistik Deskriptif	36
3.9 Uji Asumsi Klasik.....	36
3.9.1 Uji Normalitas	36
3.9.2 Uji Multikolinearitas.....	37
3.9.3 Uji Autokorelasi.....	37
3.10 Analisis Regresi	38
3.10.1 Koefisien Determinasi R^2	38
<u>BAB 4</u> ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....	41
4.1 Gambaran Umum.....	41
4.1.1 Gambaran Umum Perusahaan	41
4.2 Analisis Statistik Deskriptif.....	47
4.3 Uji Asumsi Klasik.....	50
4.3.1 Uji Normalitas	50
4.3.2 Uji Multikolinearitas.....	51

4.3.3 Uji Autokorelasi	51
4.4 Analisis Regresi.....	52
4.5 Uji F.....	53
4.6 Uji Koefisien Determinasi (R^2)	53
4.7 Pembahasan Penelitian	54
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	59
5.1 Kesimpulan.....	59
5.2 Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA.....	61
LAMPIRAN.....	65
BIODATA PENULIS.....	74

