

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN	iv
KATA PENGANTAR	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
ABSTRAK.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Pertanyaan Penelitian.....	9
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
1.5 Sistematika Penulisan	10
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	12
2.1 Landasan Teori	12
2.1.1 Keuangan Keperilakuan.....	12
2.1.2 <i>Prospect Theory</i>	13
2.2 Penelitian Terdahulu	16
2.3 Pengembangan Hipotesis.....	19
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1 Data dan Sampel.....	21
3.1.1 Pemilihan Sampel Penelitian.....	21
3.1.2 Data Penelitian	22

3.1.3	Teknik Pengumpulan Data	22
3.2	Definisi Operasional.....	23
3.2.1	<i>RETURN POSITION</i>	24
3.2.2	<i>RISK</i>	25
3.3	Model Pengujian Hipotesis	26
3.4	Uji Asumsi Klasik	27
3.4.1	Uji Normalitas.....	28
3.4.2	Uji Multikolinearitas	28
3.4.3	Uji Autokorelasi.....	29
3.4.4	Uji Heteroskedastisitas.....	29
3.5	Pemilihan Model Regresi Data Panel	30
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....		32
4.1	Statistik Deskriptif.....	32
4.2	Uji Asumsi Klasik	34
4.2.1	Uji Normalitas.....	35
4.2.2	Uji Autokorelasi.....	36
4.2.3	Uji Heteroskedastisitas.....	37
4.2.4	Treatment terhadap Uji Asumsi Klasik	38
4.3	Pemilihan Model Regresi Data Panel	39
4.3.1	Uji Spesifikasi Hausman antara <i>Fixed Effects</i> dan <i>Pooled OLS</i>	39
4.3.2	Uji Spesifikasi Hausman antara <i>Fixed Effects</i> dan <i>Random Effects</i>	41
4.3.3	Penentuan Model Regresi Data Panel yang Digunakan	42
4.4	Hasil Regresi dengan Menggunakan Model <i>Fixed Effects</i>	42
4.4.1	Uji F.....	44
4.4.2	Uji t.....	44
4.5	Hasil Regresi terhadap Industri	45
4.6	Pembahasan.....	47
BAB V SIMPULAN		53
5.1	Simpulan.....	53



5.2 Keterbatasan Penelitian	55
5.3 Saran dan Rekomendasi.....	56
DAFTAR PUSTAKA	57
LAMPIRAN	59

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Kurva Nilai Berbentuk S.....	14
Gambar 4.1	Histogram Residual Model.....	35

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Statistik Deskriptif.....	32
Tabel 4.2	Hasil Uji Autokorelasi.....	36
Tabel 4.3	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	37
Tabel 4.4	Hasil Estimasi dari Tiga Model Regresi Data Panel.....	39
Tabel 4.5	Hasil Uji Spesifikasi Hausman antara <i>Fixed Effects</i> dan <i>Pooled OLS</i>	40
Tabel 4.6	Hasil Uji Spesifikasi Hausman antara <i>Fixed Effects</i> dan <i>Random Effects</i>	40
Tabel 4.7	Hasil Regresi dengan Menggunakan Model Regresi <i>Fixed Effects</i>	43
Tabel 4.8	Hasil Uji F.....	44
Tabel 4.9	Hasil Uji t.....	45
Tabel 4.10	Hasil Regresi terhadap Masing-masing Industri.....	46