

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar.....	ix
Intisari	x
<i>Abstract</i>	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
BAB II. STUDI PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	7
2.1 Efisiensi Pasar	7
2.2 <i>Behavioral Finance</i>	9
2.3 <i>Herding Behavior</i>	10
2.4 Indeks Saham LQ 45	12
2.5 Penelitian Mengenai Perilaku <i>Herding</i>	13
2.6 Hipotesis Penelitian.....	17
BAB III. METODE PENELITIAN	19

3.1 Data dan Sampel	19
3.2 Definisi Operasional.....	19
3.3 Model Pengujian Hipotesis	20
BAB IV. HASIL DAN PEMBAHASAN	24
4.1 <i>Herding</i> pada Saham Indeks LQ 45	24
4.2 <i>Herding</i> pada Saham dengan Nilai Nominal Rendah	32
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	38
5.1 Kesimpulan	38
5.2 Saran.....	39
Daftar Pustaka	41
Lampiran	46

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Daftar Saham yang Konsisten Berada pada LQ 45 selama Februari 2009 - Juli 2014	25
Tabel 4.2. Hasil Pengujian Model 1.....	26
Tabel 4.3. Hasil Pengujian Model 2.....	29
Tabel 4.4. Daftar Saham dengan Nilai Nominal Rendah.....	33
Tabel 4.5. Hasil Pengujian Model 1 untuk Saham dengan Nilai Nominal Rendah	33
Tabel 4.6. Hasil Pengujian Model 2 untuk Saham dengan Nilai Nominal Rendah	35

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1. <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia (Model 1).....	27
Gambar 4.2. <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia (Model 2).....	30
Gambar 4.3. Perbandingan <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia dari Hasil Model 1 dan Model 2	31
Gambar 4.4. BI Rate dan <i>Herding</i>	32
Gambar 4.5. <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia Menggunakan Model 1 untuk Saham dengan Nilai Nominal Rendah.....	34
Gambar 4.6. <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia Menggunakan Model 2 untuk Saham dengan Nilai Nominal Rendah.....	36
Gambar 4.7. Perbandingan <i>Herding</i> terhadap Pasar Saham Indonesia dari Hasil Model 1 dan Model 2 untuk Saham dengan Nilai Nominal Rendah	37