

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN.....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....</b>	<b>iv</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>ii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>iii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>viii</b>
<b>INTISARI .....</b>	<b>ix</b>
<b>ABSTRACT.....</b>	<b>x</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	8
1.3 Tujuan Penelitian .....	9
1.4 Manfaat Penelitian .....	9
1.5 Sistematika Penulisan .....	10
<b>BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS .....</b>	<b>12</b>
2.1. Landasan Teori.....	12
2.1.1 Keuangan Keperilakuan.....	12
2.1.2 Prospect Theory .....	14
2.2. Penelitian Terdahulu .....	16
2.3. Pengembangan Hipotesis .....	17
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>20</b>

3.1 Data dan Sampel Penelitian .....	20
3.1.1 Sampel Penelitian.....	20
3.1.2 Data Penelitian .....	21
3.1.3 Teknik Pengumpulan Data.....	21
3.2 Definisi Operasional .....	22
3.2.1 <i>Return</i> yang Diharapkan .....	22
3.2.2 <i>Risk</i> yang Bersedia Ditanggung .....	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.....	28
3.4.4 Uji Heterokedastisitas .....	29
3.5 Pemilihan Model Regresi Data Panel .....	29
<b>BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>34</b>
4.1 Statistik Deskriptif .....	34
4.2 Uji Asumsi Klasik.....	36
4.2.1 Normalitas Data .....	36
4.2.2 Multikolinearitas .....	38
4.2.3 Autokorelasi dan Heterokedastisitas .....	38
4.3 Pemilihan Model Regresi Data Panel .....	39
4.3.1. Uji Chow antara <i>Fixed Effect</i> dan <i>Pooled OLS</i> .....	40
4.3.2 Uji Spesifikasi Hausman antara <i>Fixed Effect</i> dan <i>Random Effect</i> .....	41
4.3.3 Uji Lagrange Multiplier (LM).....	42
4.3.4 Penentuan Model Regresi Data Panel yang Digunakan.....	43
4.4 Hasil Regresi dengan menggunakan Model Random Effects.....	44
4.4.1 Uji F .....	45

4.4.2 Uji t .....	45
4.5 Regresi pada Sub-Sektor Industri .....	47
4.6 Pembahasan.....	50
<b>BAB V KESIMPULAN .....</b>	<b>53</b>
5.1. Kesimpulan .....	53
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	56
5.3 Saran dan Rekomendasi untuk Penelitian selanjutnya.....	57
<b>Lampiran .....</b>	<b>61</b>