

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI.....	iii
DAFTAR TABEL.....	v
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN.....	viii
ABSTRAK.....	ix
ABSTRACT.....	x
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	4
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
1.6 Lingkup Penelitian.....	7
1.7 Sistematika Penulisan.....	7
BAB II.....	9
TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Behavioral Finance.....	10
2.1.3 Herding Behavior	11
2.1.4 Penyebab Perilaku Herding.....	13
2.2 Penelitian Terdahulu.....	15
2.3 Pengembangan Hipotesis	17
BAB III	18
METODE PENELITIAN.....	18
3.1 Populasi dan Sampel.....	18
3.2 Definisi Operasional Variabel	18
3.4 Uji Hipotesis	20
BAB IV	23
ANALISIS DAN PEMBAHASAN	23
4.1 Deskripsi Sampel Penelitian.....	23
4.2 Analisis Statistik Deskriptif.....	26

4.3	Robust Quadratic Regression.....	29
4.3.1	Indonesia.....	31
4.3.2	Malaysia.....	31
4.3.3	Thailand.....	32
4.3.4	Singapura.....	32
4.3.5	Filipina.....	32
4.4	Uji Hipotesis.....	33
4.4.1	Indonesia.....	33
4.4.2	Malaysia.....	34
4.4.3	Thailand.....	35
4.4.4	Singapura.....	35
4.4.5	Filipina.....	36
4.5	Pembahasan Hasil Uji Hipotesis.....	37
BAB V.....		42
KESIMPULAN DAN SARAN.....		42
5.1	Kesimpulan.....	42
5.2	Implikasi.....	42
5.3	Saran.....	43
5.4	Keterbatasan.....	43
DAFTAR PUSTAKA.....		44
LAMPIRAN.....		47

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Proses Seleksi Sampel Berdasarkan <i>Purposive Sampling</i> Pada Indeks Saham LQ45 Negara Indonesia.....	24
Tabel 4.2 Proses Seleksi Sampel Berdasarkan <i>Purposive Sampling</i> Pada Indeks Saham FBM KLCI Negara Malaysia.....	24
Tabel 4.3 Proses Seleksi Sampel Berdasarkan <i>Purposive Sampling</i> Pada Indeks Saham SET50 Negara Thailand.....	25
Tabel 4.4 Proses Seleksi Sampel Berdasarkan <i>Purposive Sampling</i> Pada Indeks Saham STI Negara Singapura.....	25
Tabel 4.5 Proses Seleksi Sampel Berdasarkan <i>Purposive Sampling</i> Pada Indeks Saham PSE Index Negara Filipina.....	26
Tabel 4.6 Analisis Statistik Deskriptif pada Negara Indonesia.....	26
Tabel 4.7 Analisis Statistik Deskriptif pada Negara Malaysia.....	27
Tabel 4.8 Analisis Statistik Deskriptif pada Negara Thailand.....	27
Tabel 4.9 Analisis Statistik Deskriptif pada Negara Singapura.....	28
Tabel 4.10 Analisis Statistik Deskriptif pada Negara Filipina.....	28
Tabel 4.11 Analisis Pemilihan Estimasi Untuk Regresi Robust Pada Negara Indonesia.....	31
Tabel 4.12 Analisis Pemilihan Estimasi Untuk Regresi Robust Pada Negara Malaysia.....	31
Tabel 4.13 Analisis Pemilihan Estimasi Untuk Regresi Robust Pada Negara Thailand.....	32

Tabel 4.14 Analisis Pemilihan Estimasi Untuk Regresi Robust Pada Negara Singapura.....	32
Tabel 4.15 Analisis Pemilihan Estimasi Untuk Regresi Robust Pada Negara Filipina.....	33
Tabel 4.16 Hasil Regresi Robust Pada Negara Indonesia.....	33
Tabel 4.17 Hasil Regresi Robust Pada Negara Malaysia.....	34
Tabel 4.18 Hasil Regresi Robust Pada Negara Thailand.....	35
Tabel 4.19 Hasil Regresi Robust Pada Negara Singapura.....	36
Tabel 4.20 Hasil Regresi Robust Pada Negara Filipina.....	36

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.4.1. Hubungan <i>Market return</i> dan CSAD.....	20
---	----

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Sampel Perusahaan.....	47
Lampiran 2. Hasil Analisis Deskriptif.....	51
Lampiran 3. Hasil uji Regresi Robust Kuadratik.....	52