

## DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK.....	vii
ABSTRACT.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
<b>BAB I.....</b>	<b>1</b>
<b>PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
<b>1.1    Gambaran Umum.....</b>	<b>1</b>
1.1.1    Bursa Efek Indonesia.....	1
1.1.2    Bursa Malaysia.....	1
<b>1.2    Latar Belakang.....</b>	<b>2</b>
<b>1.3    Perumusan Masalah.....</b>	<b>10</b>
<b>1.4    Pertanyaan Penelitian.....</b>	<b>11</b>
<b>1.5    Tujuan Penelitian.....</b>	<b>11</b>
<b>1.6    Manfaat Penelitian.....</b>	<b>11</b>
1.6.1    Aspek Teoritis.....	11
1.6.2    Aspek Praktis.....	11
<b>1.7    Ruang Lingkup Penelitian.....</b>	<b>11</b>
<b>1.8    Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....</b>	<b>12</b>
<b>BAB II.....</b>	<b>13</b>
<b>TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>13</b>
<b>2.1.    Teori-Teori Terkait Penelitian.....</b>	<b>13</b>
2.1.1. <i>Behavioral Finance</i> .....	13
2.1.2.    Perilaku Herding.....	13
2.1.3.    Pasar Modal.....	14
2.1.4.    Investor.....	15

2.1.5.	<i>Return Saham</i> .....	16
2.1.6.	<i>Cross Sectional Absolute Deviation</i> .....	16
2.1.7	Regresi Kuantil .....	17
2.2.	Penelitian Terdahulu.....	19
2.3.	Kerangka Pemikiran.....	24
2.4.	Hipotesis Penelitian.....	26
<b>BAB III.....</b>		<b>27</b>
<b>METODE PENELITIAN.....</b>		<b>27</b>
3.1.	Karakteristik Penelitian .....	27
3.2.	Alat Pengumpulan Data .....	28
3.3.	Operasional Variabel .....	29
3.3.1	Variabel.....	29
3.3.2	Skala Pengukuran .....	30
3.4.	Tahapan Penelitian .....	30
3.5.	Populasi dan Sampel .....	32
3.5.1.	Populasi .....	32
3.5.2.	Sampel .....	32
3.6.	Pengumpulan Data dan Sumber Data .....	33
3.6.1.	Pengumpulan Data .....	33
3.6.2.	Sumber Data.....	33
3.7.	Teknik Analisis Data dan Penguji Hipotesis.....	33
3.7.1	Uji Regresi Kuantil.....	34
<b>BAB IV.....</b>		<b>37</b>
<b>HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>		<b>37</b>
4.2	Karakteristik Sampel.....	37
4.2.1	Cara Menghitung <i>Return Saham</i> .....	37
4.2.2	Cara Menghitung <i>Cross Sectional Absolute Deviation (CSAD)</i> .....	38
4.3	Statistik Deskriptif .....	39
4.3	Hasil Penelitian .....	40
4.3.1	Hasil Regresi Kuantil Pasar Saham Indonesia .....	40
4.3.2	Hasil Regresi Kuantil Pasar Saham Malaysia .....	42

---

5.2.1 Aspek Teoritis .....	48
5.2.2 Aspek Praktis .....	48
DAFTAR PUSTAKA.....	49
DAFTAR LAMPIRAN.....	55