

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK.....	vii
<i>ABSTRACT</i>.....	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2. Latar Belakang Penelitian	3
1.3. Perumusan Masalah	8
1.4. Pertanyaan Penelitian	9
1.5. Tujuan Penelitian	9
1.6. Manfaat Penelitian	10
1.7. Ruang Lingkup Penelitian	10
1.8. Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	12
2.1. Teori-Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu	12
2.1.1. Hipotesis Pasar Efisien.....	12
2.1.2. Investor	13
2.1.3. <i>Behavioral Finance</i>	14
2.1.4. Perilaku <i>Herding</i>	15
2.1.5. Penelitian Terdahulu	16
2.2. Kerangka Pemikiran	24
2.3. Hipotesis Penelitian	25
BAB III METODE PENELITIAN.....	26

3.1	Karakteristik Penelitian.....	26
3.2	Alat Pengumpulan Data.....	26
3.2.1	Variabel.....	26
3.2.2	Skala Pengukuran	28
3.3	Tahap Penelitian	28
3.4	Populasi dan Sampel	30
3.4.1	Populasi.....	30
3.4.2	Sampel	30
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	31
3.5.1	Jenis Data.....	31
3.5.2	Sumber Data	31
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	31
3.6.1.	Menghitung <i>Return</i>	32
3.6.2.	Menghitung CSAD	32
3.6.3.	Uji Stasioneritas	34
3.6.4.	Uji GARCH	35
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	37
4.1	Karakteristik Sampel	37
4.2	Hasil Penelitian	40
4.2.1.	Menghitung <i>Return</i>	40
4.2.2.	Menghitung CSAD	40
4.2.3.	Uji Stasioneritas	40
4.2.4.	Hasil Uji GARCH.....	46
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian	50
4.3.1.	Perilaku <i>Herding</i> pada Pasar Saham Syariah Secara Umum.....	50
4.3.2.	Perilaku <i>Herding</i> pada Pasar Saham Syariah Periode Rising Market	51
4.3.3.	Perilaku <i>Herding</i> pada Pasar Saham Syariah Periode <i>Falling</i> Market	51
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	52
5.1	Kesimpulan	52
5.2	Saran.....	52
DAFTAR PUSTAKA.....		54

LAMPIRAN.....	57
Lampiran 1. Data harga harian JII dan IHSG	57
Lampiran 2. Data <i>return market</i> dan CSAD saat kondisi <i>falling market</i> dan <i>rising market</i>	170