

DAFTAR ISI

PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.4 Kegunaan Penelitian	12
1.4 Sistematika Penulisan	12
BAB II.....	14
TINJAUAN PUSTAKA.....	14
2.1 Definisi dan Landasan Teori	14
2.1.1 Disposition Effect	14
2.1.2 Behavioral Finance	15
2.1.3 Prospect Theory	16
2.1.4 Regret Theory	17
2.1.5 Efficient Market Hypothesis	18
2.1.5.1 Efisiensi Pasar Bentuk Lemah.....	19
2.1.5.2 Efisiensi Pasar Bentuk Setengah Kuat	19
2.1.5.3 Efisiensi Pasar Bentuk Kuat	19
2.1.6 Trading Volume	20
2.1.7 Volatilitas	20
2.2 Penelitian Terdahulu	22
2.3 Hubungan Antarvariabel Penelitian.....	23
2.3.1. Disposition Effect	24

2.3.2.	<i>Trading Volume</i>	27
2.3.3.	Volatilitas	28
2.4	Kerangka Pemikiran	30
2.5	Hipotesis	31
BAB III		32
METODE PENELITIAN		32
3.1.	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	32
3.1.1.	Definisi Operasional Variabel	32
3.2	Populasi dan Sampel Penelitian	34
3.2.1	Populasi	34
3.2.2	Sampel	34
3.3	Jenis dan Sumber Data	37
3.4	Metode Pengumpulan Data	37
3.5	Metode Analisis Data	38
3.5.1	Analisis Regresi Logistik	38
3.5.1.1	Uji Multikolonieritas	40
3.5.1.2	Menilai Model Fit (<i>overall fit model</i>)	41
3.5.1.3	Pseudo R-Square	41
3.5.1.4	Goodness of Fit Test	42
3.5.1.5	Uji Wald	42
BAB IV		44
HASIL DAN ANALISIS		44
4.1	Deskripsi Objek Penelitian	44
4.2	Analisis Data	44
4.2.1	Statistik Deskriptif	45
4.2.2	Uji Multikolonieritas	47
4.2.3	Menilai Model Fit	48
4.2.4	Goodness of Fit	49
4.2.5	Koefisien Determinasi	49
4.2.6	Model Regresi yang Terbentuk	50
4.2.7.1	Model Pertama	52
4.2.7.2	Model Kedua	53
4.2.7.3	Model Ketiga	54
4.3	Interpretasi Hasil	56

BAB V	62
PENUTUP	62
5.1 Kesimpulan	62
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	62
5.3 Saran	63
DAFTAR PUSTAKA	65
LAMPIRAN-LAMPIRAN	68