

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	15
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	18
1.3.1 Tujuan Penelitian	18
1.3.2 Kegunaan Penelitian	19
1.4 Sistematika Penulisan	20
BAB II TELAAH PUSTAKA	21
2.1 Landasan Teori	21
2.1.1 Keputusan Investor	21
2.1.1.1 Kontrarian	22
2.1.1.2 Momentum	23
2.1.2 Model Indeks	24
2.1.2.1 Indeks Tunggal	24
2.1.2.2 Capital Asset Pricing Model	26

2.1.2.3	Multi Indeks	27
2.1.3	Volume Perdagangan	29
2.1.4	Return Saham	31
2.1.5	Risiko Pasar	33
2.1.6	Size	35
2.1.7	Book To Market Ratio	36
2.1.8	Momentum	37
2.2	Penelitian Terdahulu	38
2.3	Kerangka Pemikiran	50
2.3.1	Pengaruh Risiko Pasar Terhadap Keputusan Investor	51
2.3.2	Pengaruh Size Terhadap Keputusan Investor	52
2.3.3	Pengaruh Book To Market Terhadap Keputusan Investor	53
2.3.4	Pengaruh Momentum Terhadap Keputusan Investor	54
2.4	Hipotesis	56
BAB III METODE PENELITIAN		58
3.1	Variabel dan Definisi Operasional Variabel	58
3.1.1	Variabel Dependen	58
3.1.2	Variabel Independen	59
3.2	Populasi dan Sampel	64
3.3	Jenis dan Sumber Data	66
3.4	Metode Analisis	67
3.4.1	Statistik Deskriptif	67
3.4.2	Uji Asumsi Klasik	67
3.4.2.1	Uji Normalitas	67
3.4.2.2	Uji Autokorelasi	69
3.4.2.3	Uji Multikolinieritas	70
3.4.2.4	Uji Heterokedastisitas	71

3.4.3 Analisis Regresi Berganda	72
3.4.4 Pengujian Hipotesis	73
3.4.4.1 Uji Statistik F	74
3.4.4.2 Koefisien Determinasi	75
3.4.4.3 Uji Statistik T	75
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	77
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	77
4.1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	77
4.1.2 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian	80
4.2 Analisis Data	84
5.1.1 Uji Asumsi Klasik	84
4.2.1.1. Uji Normalitas	85
4.2.1.2. Uji Autokorelasi	89
4.2.1.3. Uji Multikolonieritas	90
4.2.1.4. Uji Heterokedastisitas	92
4.3 Analisis Regresi Berganda	95
4.3.1 Koefisien Determinasi (R^2)	95
4.3.2 Uji Statistik F	96
4.3.3 Uji Statistik T	96
4.4 Interpretasi Hasil	101
4.4.1 Pengaruh Risiko Pasar terhadap Keputusan Investor	102
4.4.2 Pengaruh Size terhadap Keputusan Investor	103
4.4.3 Pengaruh Book To Market terhadap Keputusan Investor	105
4.4.4 Pengaruh <i>Return</i> pada periode 3 bulan sebelum (J3) terhadap Keputusan Investor	106
4.4.5 Pengaruh <i>Return</i> pada periode 6 bulan sebelum (J6) terhadap Keputusan Investor	107
4.4.6 Pengaruh <i>Return</i> pada periode 12 bulan sebelum (J12) terhadap Keputusan Investor	108

BAB V PENUTUP	110
5.1 Simpulan	110
5.2 Keterbatasan	112
5.3 Saran	113
5.3.1 Implikasi Pada Keputusan Investasi	113
5.3.2 Bagi Peneliti	116
DAFTAR PUSTAKA	118
LAMPIRAN	122