

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	
DAFTAR GAMBAR	
DAFTAR LAMPIRAN	
1 PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Perumusan Masalah	5
Tujuan Penelitian	6
Manfaat Penelitian	6
Ruang Lingkup Penelitian	6
2 TINJAUAN PUSTAKA	7
Perilaku Keuangan	7
Sentimen Investor	7
Indeks Tendensi Bisnis	8
<i>Excess Return</i>	8
Volatilitas Saham	8
Indeks Harga Saham Gabungan	9
Sertifikat Bank Indonesia (SBI)	10
GARCH dan GJR GARCH	11
Kajian Penelitian Terdahulu	11
Kerangka Pemikiran	12
3 METODE	13
Jenis dan Sumber Data	13
Metode Analisis Data	14
Uji Statistik Deskriptif	15
Penguujian Asumsi Klasik	15
4 HASIL DAN PEMBAHASAN	17
Analisis Deskriptif	17
Penguujian Asumsi Klasik	20
Analisis Pengaruh Sentimen Investor terhadap <i>Excess Return</i>	22
Analisis Pengaruh Sentimen Investor terhadap Volatilitas <i>Excess Return</i>	25
Implikasi Manajerial	30
5 SIMPULAN DAN SARAN	32
Simpulan	32
Saran	32
DAFTAR PUSTAKA	33
LAMPIRAN	38
RIWAYAT HIDUP	52

DAFTAR TABEL

1 Jenis dan sumber data.	13
2 Analisis deskriptif return indeks sektoral dan IHSG pada BEI.	17
3 Analisis deskriptif SBI dan ITB.	19
4 Model gjr-garch terbaik pada indeks sektoral dan IHSG.	23

DAFTAR GAMBAR

1 Nilai ITB dan <i>return</i> IHSG tahun 2001 hingga 2015.	3
2 Kerangka pemikiran konseptual.	13
3 Teknik pengolahan dan analisis data.	15
4 Nilai sertifikat Bank Indonesia pada tahun 2001 hingga 2015.	19
5 Nilai indeks tendensi bisnis pada tahun 2001 hingga 2015.	20
6 Grafik volatilitas IHSG dan indeks sektoral tahun 2001 hingga 2015.	29

DAFTAR LAMPIRAN

1 Hasil uji stasioneritas variabel dependen dan independen.	39
2 Hasil uji multikolinearitas.	40
3 Model terbaik IHSG dan indeks sektoral.	42

