

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
ABSTRACT.....	xi
INTISARI.....	xii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	7
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II.....	9
LANDASAN TEORI.....	9
2.1 Landasan Teori	9
2.1.1 Investasi dan Pasar Modal.....	9
2.1.2 <i>Efficient Market Hypothesis</i>	11
2.1.3 <i>Market Anomaly</i>	12
2.1.4 <i>Market overreaction</i>	14
2.1.5 <i>Size effect</i>	16
2.1.6 <i>Liquidity Effect</i>	17
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu	18

2.3	Perumusan Hipotesis	20
2.3.1	Terjadi <i>Market Overreaction</i> di Bursa Efek Indonesia.....	20
2.3.2	Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap Fenomena <i>Market Overreaction</i> 21	
2.3.3	Pengaruh Likuiditas Saham terhadap Fenomena <i>Market Overreaction</i> 21	
2.4	Model Penelitian.....	22
BAB III		24
METODA PENELITIAN		24
3.1	Desain Penelitian	24
3.2	Metoda Pengumpulan Data	24
3.2.1	Sumber Data.....	24
3.2.2	Jenis/Tipe Data.....	25
3.2.3	Populasi dan Sampel	25
3.3	Instrumen Penelitian.....	26
3.3.1	Definisi Operasional dan Metoda Pengukuran	26
3.3.1.1	<i>Market overreaction</i>	26
3.3.1.2	<i>Firm size</i>	27
3.3.1.3	Likuiditas Saham.....	27
3.4	Metoda Analisis Data	28
3.4.1	Identifikasi Keberadaan <i>Market Overreaction</i>	28
3.5	Pengujian Hipotesis 1	31
3.6	Pengujian Hipotesis 2 dan 3	32
BAB IV		34
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		34
4.1	Deskripsi Data	34
4.2	Uji Normalitas	37
4.3	Uji Hipotesis Pertama.....	38
4.4	Uji Hipotesis 2 dan 3	42
4.4.1	Pengujian Hipotesis dengan Uji Statistik t.....	42

4.4.2	Pengujian Hipotesis dengan Uji Statistik F.....	44
4.4.3	Analisis Koefisien Determinasi (R^2).....	44
4.4.4	Uji Asumsi Klasik.....	45
4.4.4.1	Uji Multikolinearitas	45
4.4.4.2	Uji Heterokedastisitas.....	47
4.4.4.3	Uji Autokorelasi	48
4.4.4.4	Uji Normalitas	49
4.5	Diskusi dan Pembahasan	50
4.5.1	Pembahasan Hipotesis Pertama.....	50
4.5.2	Pembahasan Hipotesis Kedua dan Ketiga.....	52
BAB V	55
SIMPULAN	55
5.1	Simpulan.....	55
5.2	Implikasi.....	56
5.3	Keterbatasan dan Saran	57
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN	60