

Daftar Isi

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan	iii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis.....	iv
Kata Pengantar	v
Halaman Persembahan.....	vi
Daftar Isi	viii
Daftar Tabel	x
Daftar Bagan	xi
Daftar Lampiran.....	xii
Intisari	xiv
<i>Abstract</i>	xv
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	8
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	9
1.7 Sistematika Penulisan.....	9
BAB II. LANDASAN TEORI.....	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 Teori Efisiensi Pasar	11
2.1.2 Anomali Pasar	12
2.1.3 <i>Price Reversal</i>	13
2.1.4 <i>Price Momentum</i>	14
2.2 Penelitian Terdahulu.....	15
2.3 Hipotesis Penelitian	17

BAB III. METODE PENELITIAN	18
3.1 Populasi dan Sampel	18
3.2 Metode Pengumpulan Data	19
3.3 Definisi Operasional	19
3.4 Penentuan Hari Peristiwa	21
3.5 Pengujian Hipotesis Pertama	23
3.6 Pengujian Hipotesis Kedua	27
BAB IV. ANALISIS HASIL PENELITIAN	
4.1 Statistik Deskriptif ACAR.....	30
4.2 Uji Normalitas	44
4.3 Pengujian Hipotesis	47
4.3.1 Hasil Pengujian Hipotesis Pertama	47
4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis Kedua	50
4.4 Pembahasan	54
4.4.1 Pembahasan Hipotesis Pertama	54
4.4.2 Pembahasan Hipotesis Kedua	55
BAB V. PENUTUP	
5.1 Simpulan.....	57
5.2 Keterbatasan	58
5.3 Implikasi	59
DAFTAR PUSTAKA.....	60
LAMPIRAN	62