



## DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Judul .....	i
Lembar Pengesahan .....	ii
Lembar Pernyataan .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
ABSTRAK.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	6
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	8
2.1. Teori Efisiensi Pasar.....	8
2.2. Anomali Pasar .....	10
2.3. <i>Market Overreaction</i> .....	13
2.4. Mekanisme <i>Auto Rejection</i> di BEI.....	14
2.5. Penelitian Sebelumnya .....	16
2.6. Pengembangan Hipotesis .....	20
BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....	22
3.1. Data dan Sampel.....	22
3.2. Sumber Data dan Metode Pengumpulan Data .....	23
3.3. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	23
3.4. Identifikasi Terjadinya <i>Price Reversal</i> .....	24
3.5. Pengujian Hipotesis.....	26
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....	28



4.1.	Sampel dan Statistik Deskriptif.....	28
4.2.	Analisis Hipotesis <i>Overreaction</i> .....	29
4.3.	Analisis Pengujian <i>Size Effect</i> .....	35
BAB V	PENUTUP .....	44
5.1.	Kesimpulan.....	44
5.2.	Keterbatasan .....	45
5.3.	Saran.....	45
DAFTAR PUSTAKA	.....	46
LAMPIRAN	.....	48