

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERSETUJUAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAKSI	viii
ABSTRACT.....	ix
DAFTAR ISI.....	x1
DAFTAR LAMPIRAN	xii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GRAFIK.....	xv
BAB I.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Tujuan Penelitian	5
1.4. Manfaat Penelitian	5
1.5. Sistematika Penulisan	5
BAB II	7
2.1. Efisiensi pasar.....	7
2.2. <i>Return</i> saham	8
2.3. Abnormal Return	11
2.4. Anomali Pasar.....	11
2.5. <i>Market overreaction</i>	14
2.6. <i>Size Effect</i>	15
2.7. Penelitian Terdahulu	15
2.8. Hipotesis	16
BAB III.....	18
3.1. Desain Sampel.....	18

3.2.	Metode Pengumpulan Data	18
3.3.	Definisi Operasional	19
3.4.	Penentuan Hari Peristiwa	22
3.5.	Pengujian Hipotesis Pertama	23
3.6.	Pengujian Hipotesis Kedua	26
BAB IV	29
4.1.	Statistik Deskriptif	29
4.2.	Pengujian hipotesis	32
4.2.1.	Hipotesis pertama	32
4.2.2.	Hipotesis kedua	34
4.3.	Pembahasan hipotesis	38
4.3.1.	Peristiwa Price Reversal	38
4.3.2.	Size Effect	39
BAB V	42
5.1.	Kesimpulan	42
5.2.	Keterbatasan penelitian	43
5.3.	Saran	43
Daftar Pustaka	44