

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAKSI	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR BAGAN	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Tujuan Penelitian.....	8
1.4. Manfaat Penelitian.....	9
1.5. Sistematika Penulisan.....	9
BAB II LANDASAN TEORI.....	11
2.1. Efisiensi pasar.....	11
2.2. <i>Return</i> Saham	12
2.3. Volume Trading	13
2.4. Momentum Harga.....	14

2.5.	Faktor yang Berkontribusi dalam Momentum Harga.....	17
2.6.	<i>Price Reversals</i>	18
2.7.	Anomali Pasar	18
2.8.	Penelitian Terdahulu.....	19
2.9.	Hipotesis	22
BAB III METODE PENELITIAN.....		25
3.1.	Populasi dan Sampel Penelitian	25
3.2.	Metode Pengumpulan Data	26
3.3.	Definisi Operasional.....	27
3.4.	Penentuan Hari Peristiwa	29
3.5.	Pengujian Hipotesis Pertama.....	33
3.6.	Pengujian Hipotesis Kedua.....	39
3.7.	Pengujian Hipotesis Ketiga	41
BAB IV ANALISIS DATA		43
4.1.	Statistik Deskriptif.....	43
4.2.	Pengujian Hipotesis	66
4.2.1.	Hipotesis Pertama.....	66
4.2.2.	Hipotesis Kedua	77
4.2.3.	Hipotesis Ketiga	88
4.3.	Pembahasan Hipotesis	99
4.3.1.	Hipotesis Pertama.....	99
4.3.2.	Hipotesis Kedua	100
4.3.3.	Hipotesis Ketiga	102
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		104
5.1.	Kesimpulan.....	104



5.2. Keterbatasan Penelitian	105
5.3. Saran.....	105
DAFTAR PUSTAKA	107
LAMPIRAN.....	109