

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	10
C. Tujuan Penelitian	11
D. Asumsi Penelitian	11
E. Hipotesis Penelitian	12
F. Manfaat Penelitian	13
G. Ruang Lingkup Penelitian	15
H. Definisi Istilah.....	16
I. Kajian Penelitian Terdahulu	17
BAB II KAJIAN PUSTAKA	25
A. Hipotesis Pasar Efisien	25

B. Overreaction.....	26
C. Bid Ask Sread	28
D. Likuiditas Saham	29
E. Price Reversal	30
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	32
A. Rancangan Penelitian.....	32
B. Populasi Dan Sampel	34
C. Sumber dan Jenis Data.....	38
D. Instrumen Penelitian	40
E. Pengumpulan Data.....	41
F. Analisis Data.....	42
BAB IV DESKRIPSI, PEMBUKTIAN HIPOTESIS DAN PEMBAHASAN.....	52
A. Deskripsi Objek Penelitian	52
B. Deskripsi Data Penelitian.....	59
C. Identifikasi Price Reversal	73
D. Statistik Deskriptif	74
E. Pengujian Asumsi Klasik.....	76
F. Pengujian Hipotesis	81
G. Pembahasan	86
BAB V PENUTUP.....	97
A. Kesimpulan	97
B. Saran	99
DAFTAR RUJUKAN	101