

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
PERNYATAAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
RIWAYAT HIDUP	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
MOTTO	vii
ABSTRAK.....	viii
ABSTRACT.....	ix
KATA PENGANTAR	x
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Ruang Lingkup Penelitian	8
1.3.1 Ruang Lingkup Objek	8
1.3.2 Ruang Lingkup Subjek	8
1.3.3 Ruang Lingkup Tempat Penelitian	8
1.3.4 Ruang Lingkup Waktu Penelitian	8
1.3.5 Ruang Lingkup Ilmu Pengetahuan	9
1.4 Tujuan Penelitian	9
1.5 Manfaat Penelitian	9
1.5.1 Bagi Perusahaan	9
1.5.2 Bagi Investor	9
1.5.3 Bagi Akademis	9
1.5.4 Bagi Peneliti Selanjutnya	9
1.6 Sistematika Penulisan	10
BAB IILANDASAN TEORI	
2.1 Teori <i>Eficiency Market Hipotesis</i> (EMH).....	11
2.2 Pasar Modal	14
2.2.1 Definisi Pasar Modal	14
2.2.2 Jenis Pasar Modal	16
2.3 <i>Size Effect</i>	17
2.3.1 Pengertian <i>Size Effect</i>	17
2.3.2 Indikator <i>Size Effect</i>	18

2.4	<i>Liquidity Effect</i>	19
2.4.1	Pengertian <i>Liquidity Effect</i>	19
2.4.2	Indikator <i>Liquidity Effect</i>	19
2.5	<i>Price Reversal</i>	20
2.5.1	Pengertian <i>Price Reversal</i>	20
2.5.2	Indikator <i>Price Reversal</i>	20
2.6	Hubungan Variabel Penelitian	22
2.6.1	Hubungan <i>Size Effect</i> terhadap <i>Price reversal</i>	22
2.6.2	Hubungan <i>Liquidity Effect</i> terhadap <i>Price reversal</i>	23
2.6.3	Hubungan <i>Size</i> dan <i>Liquidity</i> terhadap <i>Price reversal</i>	24
2.7	Penelitian Terdahulu.....	25
2.8	Kerangka Pikir	26
2.9	Hipotesis	27

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Jenis Penelitian	28
3.2	Sumber Data	28
3.3	Metode Pengumpulan Data	29
3.4	Populasi dan Sampel.....	29
3.4.1	Populasi.....	29
3.4.2	Sampel	29
3.5	Variabel Penelitian	31
3.6	Definisi Operasional Variabel	31
3.7	Uji Persyaratan Analisis Data.....	32
3.7.1	Uji Normalitas.....	32
3.7.2	Uji Multikolinearitas.....	32
3.8	Metode Analisis Data	32
3.9	Uji Hipotesis	33
3.9.1	Pengaruh <i>Size</i> dan <i>liquidity</i> terhadap <i>Price Reversal</i>	33
3.9.2	Pengaruh <i>Size Effect</i> terhadap <i>price Reversal</i>	34
3.9.3	Pengaruh <i>Liquidity Effect</i> terhadap <i>Price Reversal</i>	34

BAB IV HASIL PENELITIAN

4.1	Deskripsi Objek Penelitian	37
4.2	Hasil Penelitian	42
4.2.1	Hasil Perhitungan Variabel <i>Size Effect</i>	42
4.2.2	Hasil Perhitungan Variabel <i>Liquidity Effect</i>	43
4.2.3	Hasil Perhitungan Variabel <i>Price Reversal</i>	45
4.3	Hasil Uji Persyaratan Analisis Data	46
4.3.1	Hasil Uji Normalitas	46
4.3.2	Hasil Uji Multikolinearitas	47

4.4 Hasil Uji Regresi Linear Berganda	47
4.5 Hasil Uji Hipotesis	48
4.5.1 Hasil Uji F	48
4.5.2 Hasil Uji t.....	49
4.6 Pembahasan	51
4.6.1 Pengaru <i>Size Effect</i> Terhadap <i>Price Reversal</i>	51
4.6.2 Pengaru <i>Liquidity Effect</i> Terhadap <i>Price Reversal</i>	52

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	
5.2 Saran	

54

54

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN – LAMPIRAN