

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN.....	Error! Bookmark not defined.
PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN	
 HIPOTESIS	9
2.1 Kajian Pustaka	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Anomali Pasar Modal.....	12
2.1.4 <i>Price Reversal</i>	13
2.1.5 <i>Firm Size</i>	14

2.1.6 Likuiditas	15
2.1.7 <i>Bid-Ask Spread</i>	16
2.1.8 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	18
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu	18
2.3 Kerangka Pemikiran.....	26
2.4 Hipotesis.....	28
BAB III OBJEK DAN METODOLOGI PENELITIAN	30
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	30
3.1.1 Objek Penelitian	30
3.2 Metode Penelitian	30
3.3 Operasionalisasi Variabel Penelitian	31
3.3.1 Variabel Dependen.....	31
3.3.2 Variabel Independen.....	32
3.4 Metode Pengumpulan Data	35
3.5 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	36
3.6 Metode Analisis	36
3.6.1 Pendekatan dalam Regresi Data Panel.....	37
3.6.2 Statistik Deskriptif	39
3.6.3 Uji Asumsi Klasik.....	40
3.6.4 Uji Hipotesis.....	44
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	49

4.1 Deskripsi Unit Analisis	49
4.2 Uji Kualitas Data	53
4.2.1 Uji Outlier	53
4.3 Uji Asumsi Klasik.....	54
4.3.1 Uji Normalitas	54
4.3.2 Uji Multikolinearitas.....	55
4.3.3 Uji Autokorelasi	56
4.3.3 Uji Heterokedastisitas.....	57
4.4 Pembahasan	58
4.4.1 Hasil Uji Regresi.....	60
4.4.2 Uji Hipotesis	61
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	68
5.1 Kesimpulan.....	68
5.2 Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....	70
LAMPIRAN	
RIWAYAT HIDUP	

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Matriks Penelitian Terdahulu.....	25
3.1	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	34
4.1	Statistik Deskriptif.....	49
4.2	Hasil Uji Multikolinearitas.....	56
4.3	Hasil Uji Autokorelasi.....	57
4.4	Hasil Uji Heterokedastisitas.....	57
4.5	Hasil Uji <i>Chow</i>	58
4.6	Hasil Uji <i>Hausman</i>	59
4.7	Hasil Regresi Data Panel.....	60

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
2.1	Model Penelitian.....	28
4.1	Hasil Uji Normalitas.....	55

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama Perusahaan
- Lampiran 2 Hasil *Descriptive Statistics*
- Lampiran 3 Hasil Uji Normalitas
- Lampiran 4 Hasil Uji Multikolinieritas
- Lampiran 5 Hasil Uji Heteroskedastisitas
- Lampiran 6 Hasil Uji Autokorelasi
- Lampiran 7 Hasil Uji Regresi Data Panel