

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT.....	vi
MOTO DAN PERSEMBAHAN.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	16
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	17
1.4 Sistematika Penulisan.....	18
BAB II TELAAH PUSTAKA	20
2.1 Landasan Teori	20
2.1.1 Teori Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	20
2.1.2 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	22
2.1.3 <i>Price Limit</i>	24
2.1.4 Mekanisme <i>Price Limit</i> di Indonesia	25
2.1.5 <i>Trading Halt</i>	29
2.1.6 Mekanisme <i>Trading Halt</i> di Indonesia	31
2.1.7 Konsep Reaksi Berlebihan (<i>Overreaction</i>)	32
2.1.8 <i>Volatility Spillover Hypothesis</i>	33
2.1.9 <i>Delayed Price Discovery Hypothesis</i>	34

2.1.10	Faktor-Faktor yang Dapat Terpengaruh oleh <i>Price Limit</i> dan <i>Trading Halt</i>	34
2.2	Penelitian Terdahulu.....	36
2.3	Pengaruh Antara Variabel dan Rumusan Hipotesis	45
2.3.1	Pengaruh <i>price limit</i> terhadap volatilitas return	45
2.3.2	Pengaruh <i>trading halt</i> terhadap volatilitas return.....	46
2.3.3	Pengaruh <i>price limit</i> terhadap pembentukan harga.....	47
2.3.4	Pengaruh <i>trading halt</i> terhadap pembentukan harga.	48
2.3.5	Efektivitas <i>price limit</i> dan <i>trading halt</i>	49
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	50
2.5	Hipotesis	50
BAB III METODE PENELITIAN.....		52
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	52
3.1.1	Variabel Penelitian	52
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	52
3.2	Populasi dan Sampel	60
3.3	Jenis dan Sumber Data	61
3.4	Metode Pengumpulan Data	61
3.5	Metode Analisis.....	62
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		65
4.1	Deskripsi dan Objek Penelitian	65
4.2	Analisis Data	66
4.2.1	Analisis Statistik Deskriptif	66
4.2.2	Uji Normalitas.....	68
4.2.3	Uji Hipotesis	70
4.3	Interpretasi Hasil	80
4.3.1	Pengaruh <i>price limit</i> terhadap volatilitas return.....	81
4.3.2	Pengaruh <i>trading halt</i> terhadap volatilitas return.....	82
4.3.3	Pengaruh <i>price limit</i> terhadap pembentukan harga.....	83
4.3.4	Pengaruh <i>trading halt</i> terhadap pembentukan harga	83
4.3.5	Keefektifan kinerja <i>price limit</i> dan <i>trading halt</i>	84
BAB V PENUTUP.....		86

5.1	Kesimpulan.....	86
5.2	Keterbatasan	87
5.3	Saran.....	88
	DAFTAR PUSTAKA.....	90
	LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	94