

KATA PENGANTAR

Segala puji syukur penulis panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa atas berkat, rahmat, karunia dan bimbingan-Nya yang telah diberikan sehingga penulis dapat menyelesaikan penyusunan tugas akhir ini yang berjudul “**FENOMENA MEAN REVERTING DI BURSA EFEK INDONESIA (STUDI KASUS LQ-45)**”. Penyusunan tugas akhir ini dalam rangka menyelesaikan studi dan memenuhi salah satu syarat untuk memperoleh gelar magister di Universitas Pelita Harapan.

Penulis menyadari bahwa penyusunan tugas akhir ini tidak dapat berjalan dengan lancar tanpa dukungan dan bantuan dari berbagai pihak. Dalam kesempatan ini penulis ingin mengucapkan terima kasih yang sebesar-besarnya kepada semua pihak:

1. Tuhan Yesus Kristus, karena berkat dan rahmat-Nya penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini.
2. Mama, Papa, kakak dan adik yang terkasih, atas dukungan dan doanya.
3. Juanna Judith H., SE., MA., Ph.D. selaku Ketua Magister Management
4. Prof. Dr. Hamdy Hadi, DEA., selaku Dosen Pembimbing Tugas Akhir yang telah meluangkan waktu untuk membimbing, serta memberikan bantuan dan masukan yang sangat berharga sehingga tugas akhir ini bisa selesai dengan baik.

5. Seluruh Staf Pengajar dan Karyawan Universitas Pelita Harapan yang telah memberikan bekal ilmu pengetahuan dan bantuan selama mengikuti perkuliahan sampai menyelesaikan penyusunan tugas akhir ini.
6. Leonardo Anggatama yang selalu menemani, memberikan bantuan, masukan, dukungan, doa dan semangat dalam proses penyusunan tugas akhir ini.
7. Sahabat dan teman-teman terkasih, Sofia Robianti, Wirto, dan Devandra Harahap, Basuki P. Pangemanan atas bantuan dan masukan-masukan yang telah diberikan dalam proses penyusunan tugas akhir ini.

Penulis menyadari bahwa penyusunan tugas akhir ini masih jauh dari sempurna karena adanya keterbatasan pengetahuan dan pengalaman yang dimiliki penulis. Oleh karena itu, penulis dengan hati dan pikiran terbuka sangat mengharapkan saran dan kritik yang bersifat membangun dan membimbing ke arah yang lebih baik lagi. Akhir kata, penulis berharap agar tugas akhir ini dapat bermanfaat bagi para pembaca dan pihak-pihak yang berkepentingan, khususnya untuk rekan-rekan mahasiswa/mahasiswi yang melakukan penelitian dengan topik yang sama.

Jakarta, 25 Februari 2016

Yanti

DAFTAR ISI

	Hal
HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TUGAS AKHIR	ii
PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR	iii
PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Penelitian	1
1.1.1. <i>Mean Reverting</i>	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Tujuan Penelitian	8
1.4. Manfaat Penelitian	9
1.5. Pembatasan Penelitian.....	10
1.6. Sistematika Penulisan.....	11

BAB II	KERANGKA TEORITIS DAN PENGEMBANGAN	
	HIPOTESIS..	13
	2.1. <i>Efficient Market Hypothesis</i>	13
	2.2. <i>Mean Reversion</i>	16
	2.3. Kerangka berfikir	24
	2.4. Pengembangan Hipotesis	25
BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	26
	3.1. Data	26
	3.2. <i>Return</i>	26
	3.3. Metode Analisis Data	28
	3.3.1. Model Regresi	28
	3.3.2. Uji Autokorelasi.....	30
BAB IV	ANALISIS HASIL PENELITIAN	32
	4.1. Uji Autokorelasi.....	32
	4.2. Uji Hipotesis	34
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	43
	5.1. Kesimpulan	44
	5.2. Saran	45
	DAFTAR REFERENSI	47
	LAMPIRAN	51

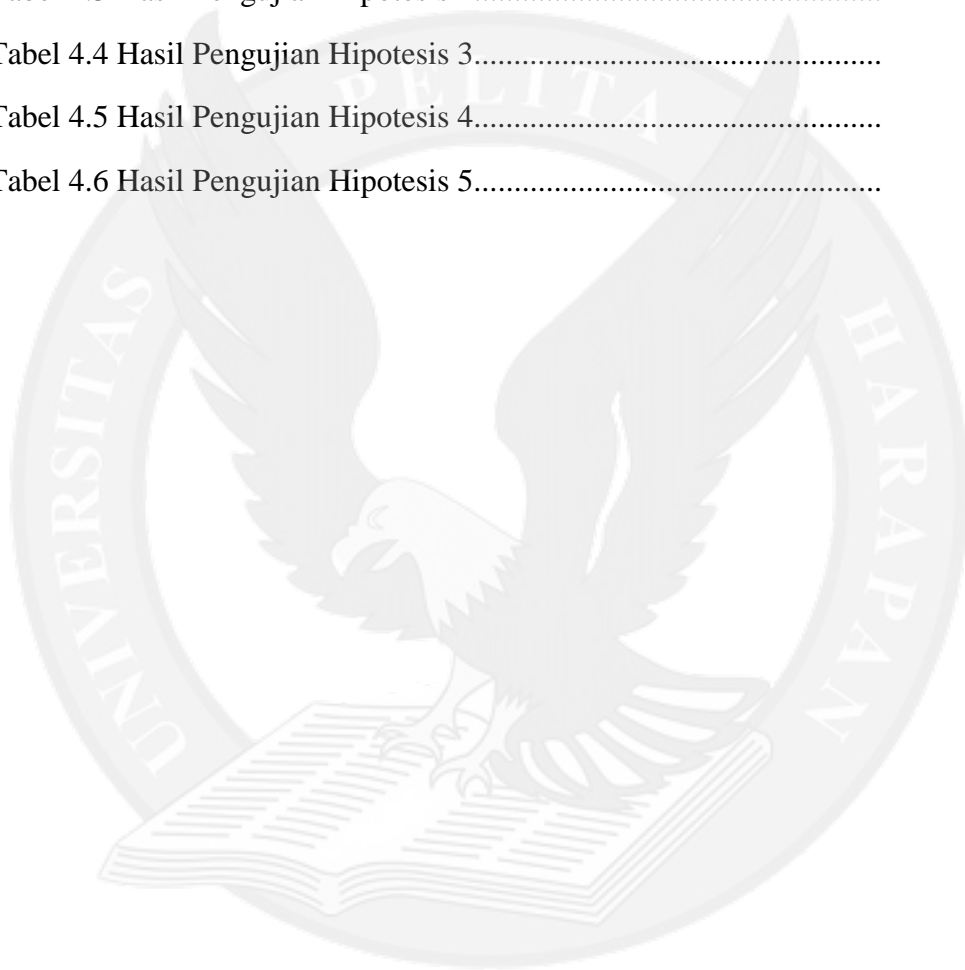
DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Ilustrasi <i>Mean Reverting</i>	17
Gambar 2.2	Kerangka Berfikir.....	24



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Kriteria Pengujian Durbin-Watson.....	33
Tabel 4.2 Hasil Pengujian Hipotesis 1.....	34
Tabel 4.3 Hasil Pengujian Hipotesis 2.....	36
Tabel 4.4 Hasil Pengujian Hipotesis 3.....	37
Tabel 4.5 Hasil Pengujian Hipotesis 4.....	39
Tabel 4.6 Hasil Pengujian Hipotesis 5.....	40



DAFTAR LAMPIRAN

	Hal
LAMPIRAN 1 Daftar <i>Return</i> yang digunakan.....	51
LAMPIRAN 2 Output E-Views	56

