

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	iii
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	8
1.4 Manfaat Penelitian.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1 Pasar Modal.....	9
2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	9
2.1.2 Karakteristik Pasar Modal	10
2.1.3 Instrumen di Pasar Modal	11
2.1.4 Peran dan Manfaat Pasar Modal.....	13
2.2 Efisiensi Pasar Modal	13
2.2.1 Definisi Efisiensi Pasar	13
2.2.2 Bentuk-bentuk Pasar Efisien	14
2.2.3 Alasan-alasan Pasar yang Efisien dan Tidak Efisien	18
2.2.4 Pengujian Efisiensi Pasar	19
2.3 Studi Peristiwa (<i>Event Studies</i>)	20
2.4 Saham.....	22
2.4.1 Pengertian Saham.....	22
2.4.2 Jenis-jenis Saham	22

2.5 Indeks Harga Saham	25
2.6 Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>)	27
2.6.1 Pengertian <i>Stock Split</i>	27
2.6.2 Tujuan <i>Stock Split</i>	27
2.6.3 Prosedur <i>Stock Split</i>	28
2.6.4 Teori <i>Stock Split</i>	29
2.7 <i>Return</i> Saham	31
2.7.1 Pengertian <i>Return</i> Saham.....	31
2.7.2 Jenis-jenis <i>Return</i> Saham	32
2.7.3 Komponen <i>Return</i> Saham	35
2.8 <i>Abnormal Return</i>	35
2.9 Penelitian Terdahulu	39
2.10 Kerangka Pemikiran.....	42
2.11 Hipotesis Penelitian.....	46
BAB III METODE PENELITIAN	47
3.1 Jenis Penelitian	47
3.2 Populasi	47
3.3 Sampel.....	48
3.4 Jenis dan Sumber Data	50
3.5 Teknik Pengumpulan Data	50
3.6 Periode Pengamatan	51
3.7 Definisi Operasional Variabel	52
3.8 Teknik Analisis Data	54
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	59
4.1 Gambaran Umum Perusahaan	59
4.2 Hasil Analisis Data	80
4.2.1 Analisis Statatistik Deskriptif.....	80
4.2.2 Uji Normalitas Data	85
4.2.3 Uji Hipotesis	86
4.3 Pembahasan.....	90
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	100
5.1 Kesimpulan	100
5.2 Saran.....	101

DAFTAR PUSTAKA	103
LAMPIRAN	106