

## DAFTAR ISI

<b>ABSTRAK</b> .....	<b>i</b>
<b>JUDUL</b> .....	<b>ii</b>
<b>PERSETUJUAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>PENGESAHAN</b> .....	<b>iv</b>
<b>RIWAT HIDUP</b> .....	<b>v</b>
<b>PERSEMBAHAN</b> .....	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>xii</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xiii</b>

### **Bab 1 PENDAHULUAN**

1.1 Latar Belakang Penelitian .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	8
1.4 Manfaat Penelitian .....	8
1.5 Kerangka Pikir .....	8
1.6 Hipotesis.....	11

### **Bab 2 LANDASAN TEORI**

2.1 Invstasi .....	12
2.1.1 Pengertian Investasi .....	12
2.1.2 Tujuan Investasi .....	13
2.1.3 Jenis-jenis Investasi.....	13
2.2 Pasar Modal.....	14
2.2.1 Pengertian Pasar Modal.....	14
2.2.2 Tujuan Pasar Modal .....	15
2.3 Saham.....	16

2.3.1 Pengertian Saham.....	16
2.3.2 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	17
2.3.3 Jenis-jenis Saham.....	18
2.4 <i>Return</i> .....	19
2.5 <i>Required Return</i> .....	22
2.6 <i>Abnormal Return</i> .....	22
2.7 Efisiensi Pasar.....	23
2.8 Studi Peristiwa ( <i>Event Study</i> ).....	24
2.9 Tinjauan Penelitian Terdahulu.....	25

### **Bab 3 METODELOGI PENELITIAN**

3.1 Sifat Penelitian.....	27
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	27
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	27
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	28
3.5 Pola <i>Event Study</i> .....	28
3.6 Alat Analisis.....	29
3.7 Pengujian Hipotesis.....	33

### **Bab 4 HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1 Profil Objek Penelitian.....	35
4.2 Hasil Perhitungan Harga Saham Sebelum dan Sesudah Penetapan Presiden Setiap Emiten Pada Periode Jendela.....	42
4.3 Hasil Perhitungan <i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah Penetapan Presiden Setiap Emiten Pada Periode Jendela.....	43
4.4 Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Penetapan Setiap Emiten Pada Periode Jendela.....	45
4.5 Perhitungan rata-rata <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Penetapan Setiap Emiten Pada Periode Jendela.....	48
4.6 Pengujian Normalitas <i>Abnormal Return</i> .....	49

4.7 Hasil Pengujian <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan sesudah Penetapan Presiden .....	50
4.8 Hasil Analisis Perbandingan Rata-rata Saham Sebelum dan sesudah Penetapan Presiden di Periode Jendela .....	53
4.9 Hasil Analisis Perbandingan Rata-rata <i>Return</i> Saham Sebelum dan sesudah Penetapan Presiden di Periode Jendela .....	54
4.10 Hasil Analisis Perbandingan Rata-rata <i>Abnormal Return</i> Saham Sebelum dan sesudah Penetapan Presiden di Periode Jendela .....	56

## **Bab 5 SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan .....	58
5.2 Saran .....	59

**DAFTAR PUSTAKA** .....

**LAMPIRAN** .....