

DAFTAR ISI

	Halaman
KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL	iii
DAFTAR GAMBAR	IV
DAFTAR LAMPIRAN	V
I. PENDAHULUAN	1
I.1 Latar Belakang	1
I.2 Permasalahan	6
I.3 Pembatasan Masalah	7
I.4 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	7
I.5 Kerangka Pikir	8
I.6 Hipotesis	10
I.7 Sistematika Penulisan	11
II. TINJAUAN PUSTAKA	13
II.1 Pasar Modal	13
II.2 Indeks Harga Saham	14
II.3 Saham	18
II.4 Efisiensi Pasar (<i>market efficiency</i>).....	19

II.5	<i>Return Saham</i>	26
II.6	Anomali Pasar	36
II.7	<i>Abnormal Return</i>	36
II.8	Studi Peristiwa (<i>event study</i>)	38
II.9	Telaah Penelitian Terdahulu	40
III. METODE PENELITIAN		42
III.1	Sifat Penelitian	42
III.2	Jenis Data	42
III.3	Metode Pengumpulan Data	43
	1. Penelitian Pustaka	43
	2. Penelitian Lapangan	43
III.4	Objek Penelitian	43
III.5	Definisi Operasional Variabel	45
III.6	Alat Analisis	46
	1. Analisis Kualitatif	46
	2. Analisis Kuantitatif	46
III.7	Pengujian Hipotesis	50
IV. HASIL DAN PEMBAHASAN		52
IV.1	Profil Objek Penelitian	52
IV.2	Hasil Analisis Return Saham	61
IV.3	Pengujian <i>Market Adjusted Model</i>	62
IV.4	Hasil Uji Asumsi Normalitas	72
IV.5	Pengujian Signifikansi Abnormal Return dengan <i>One Sample Statistic</i> di Periode Jendela	74
IV.6	Uji Beda dengan Menggunakan Paired Sample Test di Periode Jendela	78
V. KESIMPULAN DAN SARAN		81
V.1	Kesimpulan	81
V.2	Saran	82
DAFTAR PUSTAKA		83
LAMPIRAN		85