

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	10
1.4 Tujuan Penelitian	11
1.5 Manfaat Penelitian	11
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	13
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu.....	13
2.1.1 Saham.....	13
2.1.2 <i>Actual Return / Return</i> Realisasi.....	14
2.1.3 <i>Expected Return</i>	15
2.1.4 Efisiensi Pasar Modal	15
2.1.5 <i>Abnormal Return</i>	16
2.1.6 <i>Event Studies</i>	18
2.1.7 Penelitian Terdahulu	20
2.2 Kerangka Pemikiran.....	27
2.3 Hipotesis Penelitian	28
BAB III METODE PENELITIAN	29
3.1 Jenis Penelitian.....	29
3.2 Operasionalisasi Variabel	30

3.3	Tahapan Penelitian.....	31
3.4	Populasi dan Sampel.....	33
3.4.1	Populasi.....	33
3.4.2	Sampel	33
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data	34
3.6	Teknik Analisis Data.....	35
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		38
4.1	Hasil Penelitian	38
4.1.1	Statistik Deskriptif	38
4.2	Pengujian Hipotesis	42
4.2.1	Uji Normalitas Data	43
4.2.2	Uji Hipotesis	44
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian	46
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		48
5.3	Kesimpulan	48
5.2	Saran	48
DAFTAR PUSTAKA		51
LAMPIRAN.....		55