

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	3
1.3 Perumusan Masalah	5
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	6
1.5.1 Manfaat Teoritis	6
1.5.2 Manfaat Praktis	6
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Teori Terkait Penelitian.....	8
2.1.1 Hipotesis Pasar Efisien	8
2.1.2 Studi Peristiwa (Event Study)	9
2.1.3 Return Saham	11
2.1.4 Abnormal Return	13
2.2 Penelitian Terdahulu	14
2.3 Kerangka Pemikiran	22
2.4 Pengembangan Hipotesis	23
BAB III METODE PENELITIAN	24
3.1 Desain Penelitian	24
3.2 Variabel Operasional	24
3.3 Tahapan Penelitian	25

3.4 Populasi dan Sampel	26
3.4.1 Populasi	26
3.4.2 Sampel	26
3.5 Pengumpulan dan Pengolahan Data	27
3.6 Metode Analisis Data	27
3.6.1 Statistik Deskriptif	27
3.6.2 Uji Normalitas	28
3.6.3 Uji Hipotesis	28
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	31
4.1 Deskripsi Data.....	31
4.2 Analisis Data	37
4.2.1 Statistik Deskriptif	38
4.2.2 Uji Normalitas Kolmogorof Smirnov	41
4.2.3 Uji Wilcoxon Signed Rank Test	43
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	47
5.1 Kesimpulan	47
5.2 Saran.....	48
DAFTAR PUSTAKA	49
LAMPIRAN	54