

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum dan Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Perumusan Masalah	10
1.4 Tujuan Penelitian	11
1.5 Manfaat Penelitian	11
1.5.1 Aspek Teoritis.....	11
1.5.2 Aspek Praktis	11
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu	14
2.1.1 Teori Efisiensi Pasar	14
2.1.1.1 Pengertian Efisiensi Pasar	14
2.1.1.2 Bentuk-bentuk Efisiensi Pasar	14
2.1.2 Pasar Modal.....	15
2.1.3 Investasi	16
2.1.4 Saham.....	17
2.1.5 <i>Event Study</i>	17
2.1.6 <i>Return</i>	18
2.1.7 <i>Abnormal Return</i>	20
2.1.8 <i>Security Return Variability</i>	22

2.1.9 <i>Corporate Action</i>	22
2.1.10 Penelitian Terdahulu.....	24
2.2 Kerangka Pemikiran.....	36
2.3 Hipotesis Penelitian.....	38
BAB III METODE PENELITIAN	39
3.1 Jenis Penelitian.....	39
3.2 Operasionalisasi Variabel.....	40
3.3 Tahapan Penelitian.....	41
3.4 Populasi dan Sampel.....	44
3.4.1 Populasi	44
3.4.1 Sampel.....	44
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	45
3.6 Teknis Analisis Data.....	46
3.6.1 Analisis Statistik Deskriptif	46
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	46
3.6.2.1 Uji Normalitas Data	46
3.6.3 Uji Beda	47
3.6.3.1 <i>Paired Sample t-test</i>	47
3.6.3.2 <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	47
3.6.4 Uji Hipotesis	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	49
4.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	49
4.2 Uji Asumsi Klasik.....	52
4.2.1 Uji Normalitas Data.....	52
4.3 Uji Beda.....	53
4.3.1 <i>Cumulative Average Abnormal Return</i>	53
4.3.2 <i>Security Return Variability</i>	54
4.4 Pembahasan	54
4.4.1 <i>Cumulative Average Abnormal Return</i>	54
4.4.2 <i>Security Return Variability</i>	55

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	57
5.1 Kesimpulan	57
5.2 Saran	57
5.2.1 Aspek Teoritis.....	58
5.2.2 Aspek Praktis	58
DAFTAR PUSTAKA.....	59
LAMPIRAN.....	72