

DAFTAR ISI

DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR GAMBAR	v
DAFTAR LAMPIRAN	vi
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	6
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	8
1.7 Sistematika Penulisan	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Capital Market	10
2.2 Efficient Market Hypothesis (EMH)	11
2.3 Kontradiksi Empiris pada <i>Efficient Market Hypothesis</i>	13
2.3.1 Noise Trading.....	13
2.3.2 Overreaction	14
2.3.3 Price Limit Theory.....	14
2.3.4 Herd Behaviour.....	15
2.4 Event Study.....	15
2.5 Abnormal Return	17
2.6 Hipotesis Penelitian	17
BAB III METODA PENELITIAN	19
3.1 Sumber dan Jenis Data.....	19
3.2 Sampel Data	19
3.3 Periode jendela dan periode estimasi	22

3.4 Definisi Operasional -----	22
BAB IV PEMBAHASAN -----	25
4.1 <i>Abnormal Return Saham Pada Setiap Peristiwa</i> -----	25
4.2 <i>Cummulative Abnormal Return (CAR)</i> -----	29
4.3 <i>Cummulative Average Abnormal Return (CAAR)</i> -----	40
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN -----	45
5.1 Kesimpulan -----	45
5.2 Saran-----	46
TINJAUAN PUSTAKA -----	47
LAMPIRAN -----	49
Hasil Perhitungan <i>Actual Return</i> dan <i>Expected Return</i> -----	85
Hasil Perhitungan <i>Alpha</i> dan <i>Beta Saham</i> -----	113
Uji Normalitas Abnormal Return-----	116