

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
KATA PENGANTAR	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI	xiii
<i>ABSTRACT</i>	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. LATAR BELAKANG	1
1.2. RUMUSAN MASALAH.....	4
1.3. PERTANYAAN PENELITIAN	5
1.4. TUJUAN PENELITIAN.....	5
1.5. MANFAAT PENELITIAN.....	5
1.6. SISTEMATIKA PENULISAN.....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1. LANDASAN TEORI.....	7
2.1.1. PASAR MODAL	7
2.1.2. MSCI INDEX INDONESIA.....	7
2.1.3. EFISIENSI PASAR MODAL.....	8
2.1.4. STUDI PERISTIWA.....	9
2.2. PENELITIAN TERDAHULU	11
2.3. PENGEMBANGAN HIPOTESIS	15
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1. DATA DAN SAMPEL	21
3.2. DEFINISI OPERASIONAL DAN PENGUKURUAN VARIABEL	22
3.2.1. RETURN SAHAM	22

3.2.2.	LIKUIDITAS SAHAM.....	24
3.3.	METODE ANALISIS DATA.....	25
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		27
4.1.	STATISTIK DESKRIPTIF	27
4.2.	ANALISIS DATA AAR DAN CAAR	32
4.3.	UJI ASUMSI.....	34
4.4.	UJI HIPOTESIS	37
BAB V PENUTUP.....		55
5.1.	KESIMPULAN.....	55
5.2.	KETERBATASAN.....	56
5.3.	SARAN	57
5.4.	IMPLIKASI	57
DAFTAR PUSTAKA		59
LAMPIRAN.....		62