

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
ABSTRAK	ix
ABSTRACT	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Pertanyaan Penelitian	7
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Lingkup Penelitian	9
1.7. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI	11
2.1. Landasan Teori	11
2.1.1. Saham	11
2.1.2. Indeks Saham	13
2.1.3. Studi Peristiwa	14
2.1.4. Abnormal Return	15
2.1.5. Likuiditas dan Volume Perdagangan Abnormal	18
2.1.6. Risiko	20
2.2. Perumusan Hipotesis	22
2.2.1. Abnormal Return pada Peristiwa Penyertaan dan Pengeluaran Saham dalam Indeks	22
2.2.2. Volume Perdagangan Abnormal pada Peristiwa Penyertaan dan Pengeluaran Saham dalam Indeks	25
2.2.3. Perubahan Risiko pada Peristiwa Penyertaan dan Pengeluaran Saham dalam Indeks	25
2.2.4. Efek Permanen atau Jangka Panjang dari Abnormal Return dan Volume Perdagangan Abnormal pada Peristiwa Penyertaan dan Pengeluaran Saham dalam Indeks	26

2.3.	Varibel Penelitian.....	31
BAB III METODA PENELITIAN		32
3.1.	Desain Penelitian.....	32
3.2.	Metoda Pengumpulan Data	33
3.3.	Instrumen dan Metoda Analisis Data	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		42
4.1.	Deskripsi Sampel	42
4.2.	Analisis Data dan Hasil Pengujian	44
4.2.1.	Abnormal Return.....	44
4.2.2.	Likuiditas (Volume Perdagangan Abnormal)	49
4.2.3.	Risiko	54
4.3.	Pembahasan.....	55
BAB V KESIMPULAN		61
5.1.	Kesimpulan	61
5.2.	Implikasi.....	63
5.3.	Keterbatasan.....	64
5.4.	Saran.....	64
DAFTAR PUSTAKA		66
LAMPIRAN.....		68