

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR.....	ii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR ISTILAH	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Kerangka Penelitian	8
BAB II	10
2.1 Kondisi Umum.....	10
2.1.1 Pasar Modal Indonesia	10
2.1.2 Bursa Efek Indonesia	11
2.1.3 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	12
2.1.4 Peresmian Danantara.....	14
2.1.5 Return.....	15
2.1.6 Abnormal Return.....	16
2.2 Tinjauan Pustaka	17
2.2.1 Teori Sinyal (Signalling Theory).....	17
2.2.2 Efficient Market Hypothesis	18
2.2.3 Penelitian Terdahulu.....	19
2.3 Keaslian Penelitian.....	24
2.4 Pengembangan Hipotesis dan Kajian Teori	25
2.4.1 Hubungan antara Return Saham BUMN dengan Publikasi Informasi....	26
2.4.2 Hubungan antara IHSG dengan Publikasi Informasi	26

2.4.3	Hubungan antara Publikasi Informasi dengan <i>LQ 45 Index</i>	27
BAB III	28
3.1	Desain Penelitian.....	28
3.2	Jenis dan Sumber Data	29
3.3	Teknik Pengumpulan Data	29
3.4	Populasi dan Sampel	29
3.5	Definisi Operasional Variabel	31
3.6	Teknik Analisis Data	36
BAB IV	41
4.1	Deskriptif Data	41
4.2	Analisis Hasil Penelitian	42
4.2.1	Uji Normalitas	42
4.2.2	Uji Hipotesis	45
4.3	Pembahasan.....	53
4.3.1	Pengaruh Peresmian Danantara terhadap Return Saham-Saham BUMN 53	
4.3.2	Pengaruh Peresmian Danantara terhadap Pergerakan Return Pasar	55
4.3.3	Pengaruh Peresmian Danantara terhadap Pergerakan Indeks LQ45	56
BAB V	58
5.1	Kesimpulan	58
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	58
5.3	Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA	61
LAMPIRAN	64