



## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR .....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
ABSTRAK .....	xiii
<i>ABSTRACT</i> .....	xiv
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	6
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	7
1.6 Sistematika Penulisan .....	7
<b>BAB II LANDASAN TEORI.....</b>	<b>9</b>
2.1 Landasan Teori .....	9
2.1.1 Pasar Modal .....	9
2.1.2 Efisiensi Pasar .....	10
2.1.3 Investasi.....	13
2.1.4 <i>Abnormal Return</i> dan <i>Expected Return</i> .....	14
2.1.5 Studi Peristiwa ( <i>Event Study</i> ) .....	16
2.1.6 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) .....	20
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu.....	20
2.3 Perumusan Hipotesis.....	23
2.3.1 Sektor Perbankan .....	23
2.3.2 Sektor <i>Property &amp; Real Estate</i> .....	25
2.3.3 Sektor Barang Konsumsi .....	27
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>29</b>
3.1 Desain penelitian .....	29
3.2 Metode Pengumpulan Data .....	30
3.3 Instrumen Penelitian.....	34



3.3.1	<i>Actual Return</i> .....	34
3.3.2	<i>Expected Return</i> .....	34
3.3.3	<i>Abnormal Return</i> .....	35
3.3.4	<i>Cumulative Abnormal Return</i> .....	36
3.4	Metode Analisis Data.....	36
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>		<b>38</b>
4.1	Deskripsi Data .....	38
4.2	Pengujian Hipoteis .....	43
4.2.1	Sektor Perbankan .....	43
4.2.2	Sektor <i>Property &amp; Real Estate</i> .....	44
4.2.3	Sektor Barang Konsumsi .....	45
4.3	Diskusi dan Pembahasan.....	46
4.3.1	Sektor Perbankan .....	46
4.3.2	Sektor <i>Property &amp; Real Estate</i> .....	48
4.3.3	Sektor Barang Konsumsi .....	50
<b>BAB V SIMPULAN .....</b>		<b>52</b>
5.1	Simpulan.....	52
5.2	Implikasi .....	53
5.3	Keterbatasan .....	54
5.4	Saran .....	55
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>56</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>59</b>