

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GRAFIK	ix
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
I. 1. Latar Belakang Penelitian	1
I. 2. Rumusan Masalah Penelitian	5
I. 3. Tujuan Penelitian	5
I. 4. Manfaat Penelitian	6
BAB II	7
RERANGKA TEORITIS DAN KONSTRUK	7
II. 1. Pasar Modal	8
II. 2. <i>Country Risk</i>	9

II.2.1. <i>Political Risk</i>	11
II.2.2. Faktor – Faktor yang Mempengaruhi <i>Political Risk</i>	12
II. 3. <i>Event Study</i>	17
II. 4. Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis	18
BAB III	20
METODOLOGI PENELITIAN	20
III. 1. Bentuk Penelitian	20
III. 2. Periode Pengamatan	20
III. 3. Objek Penelitian	22
III. 4. Teknik Pengumpulan Data	22
III. 5. Metode Analisis Data	23
III. 6. Pengujian Hipotesis 1.....	26
III. 7. Pengujian Hipotesis 2.....	27
BAB IV	28
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	28
IV. 1 Analisis Data	28
IV.1.1. Average Abnormal Return (AAR) dan Cumulative Average Abnormal Return (CAAR) Data Harian.....	31
IV.1.2. Cumulative Abnormal Return (CAR) Industri Sektoral	33
IV. 2. Pengujian Hipotesis 1	35
IV. 3. Pengujian Hipotesis 2	37

BAB V	40
KESIMPULAN DAN SARAN	40
V. 1. Kesimpulan	40
V. 2. Keterbatasan	41
V. 3. Saran	41
DAFTAR PUSTAKA	42
LAMPIRAN	44

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 Hasil Perhitungan nilai Average Abnormal Returns dan Cumulative Average Abnormal Return	34
---	----

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Daftar Klasifikasi Sektor didalam Bursa Efek Indonesia periode Februari-Juli 2014.....	22
Tabel 4.1 Hasil Perhitungan nilai <i>Abnormal Return</i>	30
Tabel 4.2 Hasil Perhitungan nilai Average Abnormal Returns dan Cumulative Average Abnormal Return	32
Tabel 4.3 Hasil Perhitungan nilai Cumulative Abnormal Return	34
Tabel 4.4 Hasil Perhitungan Uji t.....	36

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Perhitungan Uji F	44
------------------------------------	----