

Daftar Isi

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI.....	iv
MOTTO.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
ABSTRACT.....	x
INTISARI.....	xi
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 LATAR BELAKANG.....	1
1.2 RUMUSAN MASALAH	10
1.3 TUJUAN PENELITIAN	12
1.4 MANFAAT PENELITIAN	12
1.5 RUANG LINGKUP DAN BATASAN PENELITIAN	13
1.6 SISTEMATIKA PENELITIAN	14
BAB II LANDASAN TEORI.....	16
2.1 <i>EVENT STUDY</i>	16
2.2 EFISIENSI PASAR.....	22
2.3 <i>RETURN</i>	27
2.3.1. <i>REALIZED RETURN</i>	27
2.3.2. <i>EXPECTED RETURN</i>	29
2.3.3. <i>ABNORMAL RETURN</i>	32
2.3.4. <i>AVERAGE ABNORMAL RETURN</i>	32
2.3.5. <i>CUMULATIVE AVERAGE ABNORMAL RETURN</i>	33
2.4 PENGEMBANGAN HIPOTESIS	34
2.4.1 PENGEMBANGAN HIPOTESIS 1 (H1)	34

2.4.2	PENGEMBANGAN HIPOTESIS 2(H2)	38
2.5	KERANGKA PEMIKIRAN TEORITIS	40
BAB III	METODE PENELITIAN	41
3.1	DEFINISI OPERASIONAL VARIABEL	41
3.2	IDENTIFIKASI PERISTIWA DAN PERIODE PENELITIAN	41
3.3	JENIS DATA DAN SUMBER DATA	42
3.4	POPULASI DAN SAMPEL PENELITIAN	43
3.5	TEKNIK ANALISIS DAN PENGUJIAN HIPOTESIS	44
3.5.1.	TEKNIK ANALISIS	44
3.5.2.	PENGUJIAN HIPOTESIS 1	44
3.5.3.	PENGUJIAN HIPOTESIS 2	47
BAB IV	ANALISIS DAN PEMBAHASAN	49
4.1	DESKRIPSI SAMPEL PENELITIAN	49
4.2	HASIL DESKRIPSI DATA	51
4.3	PENGUJIAN DAN ANALISIS HIPOTESIS PERTAMA (H1)	52
4.4.1.	UJI NORMALITAS <i>ABNORMAL RETURN</i>	53
4.4.2.	UJI <i>ONE SAMPEL T TEST</i> (PERISTIWA PERTAMA)	53
4.4.3.	UJI <i>ONE SAMPEL T TEST</i> (PERISTIWA KEDUA)	56
4.4	PENGUJIAN DAN ANALISIS HIPOTESIS KEDUA (H2)	59
BAB V	PENUTUP	62
5.1	KESIMPULAN	62
5.2	KETERBATASAN PENELITIAN	63
5.3	SARAN	63
	DAFTAR PUSTAKA	65
	LAMPIRAN	68