



DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Halaman Persembahan	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vii
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar	ix
Daftar Lampiran	x
Intisari	xi
Abstract	xii
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1 latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Batasan Penelitian	7
1.6 Keaslian Penelitian	8
1.7 Sistemetika Pembahasan	9
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA DAN HIPOTESIS	
2.1 Informasi dan Laporan Keuangan	11
2.2 Efisiensi Pasar Modal	19
2.3 Abnormal Return	31
2.4 Studi Peristiwa	33
2.5 Penelitian Terdahulu	34
2.6 Hipotesis	35
BAB III. METODOLOGI PENELITIAN	
3.1 Populasi dan Penentuan Sampel	36
3.2 Data dan Sumber Data yang Digunakan	36
3.3 Devinisi Operasional Variabel	38
3.4 Metode Analisis Data	40
BAB IV. ANALISIS DATA DAN HASIL PENELITIAN	
4.1 Analisis Penelitian	53
4.2 Pembahasan Hipotesis Penelitian	64
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Keterbatasan Penelitian	69
5.3 Saran	69
Daftar Pustaka	72
Lampiran	



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Rata-rata Abnormal Return (Good News).....	54
Tabel 4.2. Rata-rata Abnormal Return (Bad News).....	55
Tabel 4.3. Deskriptif Statistik variabel penelitian	57
Table 4.4. Hasil Regresi berganda dengan metode OLS	58
Tabel 4.5. Hasil estimasi dari Uji t	59
Tabel 4.4. Hasil Uji Multikolinearitas	61
Tabel 4.5. Hasil Uji Heteroskedasitas	62
Tabel 4.6. Hasil Uji Autokorelasi	63



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis pengaruh perubahan laba (rugi) selisih kurs, perubahan EPS, perubahan cash flow, terhadap cumulative abnormal return di sekitar tanggal publikasi laporan keuangan :: Study kasus saham-saham

LQ 45 pada BEI

JANAH, Siti Nur, Mamduh M. Hanafi, Dr., MBA

Universitas Gadjah Mada, 2008 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Bentuk Efisiensi Pasar	22
Gambar 3.1. <i>Estimation & Event Period</i>	38
Gambar 4.1. Perilaku Abnormal Return di sekitar <i>Event Period</i> (Good News).....	54
Gambar 4.2. Perilaku Abnormal Return di sekitar <i>Event Period</i> (Bad News)	56
Gambar 4.3. Hasil Uji Normalitas	60



DAFTAR LAMPIRAN

Lamp 1. Daftar saham yang masuk dalam penghitungan indeks LQ 45 periode Februari 2008 – Juli 2008	75
Lamp 2. Data Tgl Publikasi Laporan Keuangan Perusahaan yang dijadikan sampel	76
Lamp 3. Data Harga penutupan harian Indeks Harga Saham Gabungan.....	77
Lamp 4. Data AR harian disekitar tanggal publikasi laporan keuangan	79
Lamp 5. Data variabel penelitian dalam regresi berganda	80
Lamp 6. Hasil estimasi dari <i>White Heteroskedasticity Test</i>	81
Lamp 7. Hasil estimasi dari <i>Breusch-Godfrey serial Correlation LM Test</i>	82
Lamp 8. One sample t-test (good news).....	83
Lamp 9. One sample t-test (bad news).....	84