

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel	ix
Daftar Gambar	x
Lampiran	xi
Intisari	xii
Abstrak	xiii
BAB 1: PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
1. Perumusan Masalah	6
2. Keaslian Penelitian	6
B. Tujuan Penelitian	7
C. Manfaat Penelitian	7
D. Sistematika Pembahasan	8
BAB 2: TINJAUAN LITERATUR DAN HIPOTESIS	10
A. Tinjauan Literatur	10
1. Pengertian <i>Mortgage</i>	10

2. <i>Mortgage Backed Securities (MBS)</i>	11
3. <i>Krisis Subprime Mortgage</i>	14
4. <i>Pasar Modal</i>	19
5. <i>Pasar Modal Indonesia</i>	21
6. <i>LQ45</i>	22
B. <i>Landasan Teori</i>	23
1. <i>Efficient Market Hypothesis</i>	23
2. <i>Pengujian terhadap efisiensi setengah kuat</i>	25
3. <i>Event Study</i>	26
4. <i>Estimasi return pada event study</i>	28
5. <i>Abnormal Return</i>	30
C. <i>Penelitian Sebelumnya</i>	32
1. <i>The effect of PN4 Announcements on Shares Prices: Evidence from Bursa Malaysia</i>	32
2. <i>Price Reaction to Rights Issues in the Indian Capital Market</i>	32
3. <i>The Impact of Terrorism on Financial Markets: An Empirical Study</i>	33
4. <i>An Empirical Study of the Impact of Internet Financial Reporting on Stock Prices</i>	34
D. <i>Hipotesis</i>	35
BAB 3: METODE PENELITIAN	36
A. <i>Desain Riset</i>	36

B. Periode Penelitian	37
C. Populasi dan Penyampelan	39
D. Metode Pengumpulan Data	41
E. Definisi Operasional Variabel	42
F. Prosedur Analisa	42
BAB 4: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	47
A. Hasil Penelitian	47
B. Pembahasan	56
1. Pengujian statistik terhadap <i>return</i> tidak normal	56
BAB 5: KESIMPULAN DAN SARAN	61
A. Kesimpulan	61
B. Saran	62

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN