



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	
PENGESAHAN	
PERNYATAAN	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR TABEL	viii
INTISARI	ix
ABSTRACT	x
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Keaslian Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	8
E. Tujuan Penelitian	8
F. Sistematika Penelitian	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Landasan Teori	10
1. Konsep Risiko dan Return	10
2. Portofolio	12
3. Teori <i>Capital Asset Pricing Model</i>	13
4. Konsep Beta	14
5. <i>Overreaction Hypothesis</i>	16

	6. Konsep <i>Uncertain Information Hypothesis</i>	18
	B. Hipotesis	20
BAB III	METODE PENELITIAN	
	A. Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel	23
	B. Data dan Sumber Data	24
	C. Model dan Metode Analisis Data	24
	1. Menghitung <i>return</i> saham dan <i>return</i> pasar harian.	24
	2. Menentukan <i>Abnormal Return</i>	24
	3. Penentuan Portofolio	25
	4. Menentukan <i>Comulative Abnormal Return</i>	26
	5. Melakukan uji statistik t-hitung	27
	6. Pengujian Beta	27
BAB IV	ANALISIS DAN PEMBAHASAN	
	A. Gambaran Data Penelitian	29
	B. Pengujian Hipotesis 1	32
	C. Pengujian hipotesis 2	33
	D. Pengujian hipotesis 3	35
	E. Pengujian hipotesis 4	37
	F. Pengujian hipotesis 5	40
	G. Pengujian hipotesis 6	41
	H. Pengujian hipotesis 7 dan 8	42
	I. Pengujian hipotesis 9	43



	J. Diskusi Hasil	44
BAB V	PENUTUP	
	A. Kesimpulan	49
	B. Saran	49
DAFTAR PUSTAKA		xi
LAMPIRAN		