

Daftar Isi

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERNYATAAN.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iv
Daftar Isi	v
Daftar Tabel.....	vii
Daftar Gambar	viii
Daftar Lampiran	ix
INTISARI.....	x
ABSTRACTS	xi
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Kontribusi dan Manfaat Penelitian	8
1.5 Batasan dan Lingkup Penelitian.....	10
1.6 Sistematika Penulisan	10
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA DAN PERUMUSAN HIPOTESIS.....	12
2.1 Indeks Saham Sektoral.....	12
2.2 Return Tak Normal (<i>Abnormal Return</i>)	13
2.3 Teori Efisiensi Pasar	13
2.4 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	15
2.5 Tinjauan Pustaka	17
2.6 Hipotesis Penelitian.....	20
BAB III. METODE PENELITIAN	25
3.1 Populasi dan Sampel	25
3.2 Jenis dan Sumber Data	25
3.3 Penentuan Periode Penelitian.....	25
3.4 Metode Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	27
BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN	31
4.1 Data	31
4.2 Statistik Deskriptif	31
4.3 Uji Normalitas Data	34
4.4 Pengujian Hipotesis 1	36
4.4.1 Sektor Keuangan (Non-Bank).....	36

4.4.2 Sektor Industri Dasar dan Kimia	38
4.4.3 Sektor Aneka Industri	40
4.4.4 Sektor Industri Barang Konsumsi	41
4.4.5 Rangkuman Hasil Pengujian Hipotesis 1 (H1)	43
4.5 Pengujian Hipotesis 2	45
4.5.1 Sektor Industri Dasar dan Kimia	46
4.5.2 Sektor Aneka Industri	47
4.5.3 Sektor Industri Barang Konsumsi	48
4.5.4 Rangkuman Hasil Pengujian Hipotesis 2 (H2)	49
BAB V. KESIMPULAN	51
5.1 Kesimpulan	51
5.2 Keterbatasan Penelitian	53
5.3 Saran	54
DAFTAR PUSTAKA	55