

DAFTAR ISI

Lembar Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Gambar dan Grafik	vii
Daftar Tabel	ix
Daftar Lampiran.	x
Abstract	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	2
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Ruang Lingkup Penelitian	7
1.6 Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1 Pasar Modal	10
2.2 <i>Return Saham</i>	11
2.3 <i>Return Tidak Normal (Abnormal Return)</i>	14
2.4 <i>Efficient Market Theory</i>	15
2.5 Hipotesis Penelitian	20
BAB III METODA PENELITIAN	21
3.1 Desain Penelitian	21
3.2 Peristiwa Amatan	21
3.3 Populasi dan Sampel.....	22
3.4 Periode Pengamatan	22
3.5 Jenis dan Sumber Data.....	23
3.6 Metode Analisis Data	24

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	30
4.1 Deskripsi Data	30
4.1.1 Data Harga Saham	30
4.1.2 Data Peristiwa Amatan	31
4.2 Pengujian Hipotesis dan Pembahasan	34
4.2.1 Uji Hipotesis pada tiap peristiwa amatan.....	23
1. Uji H0 Peristiwa Amatan 1 tanggal 8 Maret 2018	34
2. Uji H0 Peristiwa Amatan 2 tanggal 2 April 2018	37
3. Uji H0 Peristiwa Amatan 3 tanggal 3 April 2018	40
4. Uji H0 Peristiwa Amatan 4 tanggal 4 April 2018	43
5. Uji H0 Peristiwa Amatan 5 tanggal 10 Juli 2018	46
6. Uji H0 Peristiwa Amatan 6 tanggal 1 Agustus 2018	48
7. Uji H0 Peristiwa Amatan 7 tanggal 7 Agustus 2018	51
8. Uji H0 Peristiwa Amatan 8 tanggal 7 September 2018	54
9. Uji H0 Peristiwa Amatan 9 tanggal 7 September 2018	57
10. Uji H0 Peristiwa Amatan 10 tanggal 1 Desember 2018	60
11. Uji H0 Peristiwa Amatan 11 tanggal 24 Februari 2019	63
12. Uji H0 Peristiwa Amatan 12 tanggal 5 Mei 2019	66
13. Uji H0 Peristiwa Amatan 13 tanggal 8 Mei 2019	69
14. Uji H0 Peristiwa Amatan 14 tanggal 15 Mei 2019	72
15. Uji H0 Peristiwa Amatan 15 tanggal 30 Mei 2019	75
16. Uji H0 Peristiwa Amatan 16 tanggal 29 Juni 2019.....	78
17. Uji H0 Peristiwa Amatan 17 tanggal 4 Juli 2019.....	81
18. Uji H0 Peristiwa Amatan 18 tanggal 9 Juli 2019.....	84
19. Uji H0 Peristiwa Amatan 19 tanggal 29 Juni 2019.....	87
20. Uji H0 Peristiwa Amatan 20 tanggal 5 Agustus 2019.....	90
21. Uji H0 Peristiwa Amatan 21 tanggal 6 Agustus 2019.....	93
22. Uji H0 Peristiwa Amatan 22 tanggal 13 Agustus 2019.....	96
23. Uji H0 Peristiwa Amatan 23 tanggal 5 Agustus 2019.....	99
24. Uji H0 Peristiwa Amatan 24 tanggal 21 Agustus 2019.....	102
25. Uji H0 Peristiwa Amatan 25 tanggal 23 Agustus 2019.....	105
26. Uji H0 Peristiwa Amatan 26 tanggal 1 September 2019.....	108
4.2.2 Uji Hipotesis pada AAR dari 26 Peristiwa Amatan.....	111



4.2.3 Uji Hipotesis pada CAAR dari 26 Peristiwa Amatan.....	113
4.2.3 Tabel Hasil Uji Hipotesis CAR pada tiap Peristiwa Amatan	116
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	127
5.1 Kesimpulan	127
5.2 Saran	128
DAFTAR PUSTAKA	129