

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN KEASLIAN KARYA TULIS	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.1 Rumusan Masalah	7
1.2 Pertanyaan Penelitian	8
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
1.5 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	9
1.6 Sistematika Penelitian	9
BAB II LANDASAN TEORI DAN PERUMUSAN HIPOTESIS	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 Teori Efisiensi Pasar	11
2.1.2 Teori Studi Peristiwa	12
2.1.3 Return Tak Normal (<i>Abnormal Return</i>)	13
2.1.4 Return Realisasi (<i>Actual Return</i>)	14
2.1.5 Return Ekspektasi (<i>Expected Return</i>)	14
2.1.6 Return Tak Normal Kumulatif (<i>Cumulative Abnormal Return</i>) ...	16

2.2 Penelitian Terdahulu	18
2.3 Pengembangan Hipotesis	19
BAB III METODE PENELITIAN	20
3.1 Sampel dan Data Penelitian	20
3.1.1 Sampel Penelitian	20
3.1.2 Data Penelitian	22
3.1.3 Teknik Pengumpulan Data	22
3.1.4 Definisi Operasional	23
3.1.5 Studi Peristiwa	23
3.2 Teknik Analisis Data	24
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	27
4.1 Statistik Deskriptif	27
4.2 Uji Normalitas	31
4.3 Pengujian Hipotesis	33
4.4 Pembahasan Hipotesis	36
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	38
5.1 Simpulan	38
5.2 Keterbatasan Penelitian	38
5.3 Saran	39
5.4 Implikasi Penelitian	39
DAFTAR PUSTAKA	40
LAMPIRAN	43
Lampiran 1 Statistik deskriptif <i>abnormal return</i>	43
Lampiran 2 Uji normalitas <i>abnormal return shapiro-wilk w-test for normal data</i>	44

Lampiran 3 Uji signifikansi <i>abnormal return</i>	45
Lampiran 4 Statistik deskriptif <i>cumulative abnormal return</i>	46
Lampiran 5 Uji normalitas cumulative abnormal return shapiro-wilk w-test for normal data.....	47
Lampiran 6 Uji signifikansi <i>cumulative abnormal return</i>	48