

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Permasalahan	1
1.2. Rumusan Permasalahan	7
1.3. Pertanyaan Penelitian	8
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Sistematika Penulisan.....	9
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1. Telaah Literatur.....	10
2.1.1. Pasar Modal.....	10
2.1.2. Nilai Tukar Rupiah.....	12
2.1.3. Pasar Efisien.....	15
2.1.4. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	17
2.1.7. Return & Return Tak Normal.....	19
2.2. Penelitian Terdahulu	22
2.3. Pengembangan Hipotesis	24
BAB 3 METODA PENELITIAN	27
3.1. Jenis dan Sumber Data	27
3.1.1. Jenis Data	27
3.1.2. Sumber Data.....	27
3.2. Populasi dan Sampel Penelitian	28

3.3.	Variabel Penelitian & Definisi Operasional.....	29
3.3.1.	Variabel Penelitian	29
3.3.2.	Definisi Operasional	29
3.4.	Perioda Penelitian	30
3.5.	Teknik Analisis Data.....	31
BAB 4 ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN		37
4.1.	Deskripsi Sampel	37
4.2.	Deskripsi Data Penelitian.....	38
4.3.	Statistik Deskriptif	39
4.3.1.	Abnormal Return di Sekitar Peristiwa (16 Desember 2014).....	39
4.3.2.	Abnormal Return di Sekitar Peristiwa (12 Agustus 2015).....	42
4.3.3.	Abnormal Return di Sekitar Peristiwa (29 September 2015).....	44
4.3.4.	Abnormal Return di Sekitar Peristiwa (14 Desember 2015).....	46
4.4.	Analisis Statistik	49
4.4.1.	Pengujian Reaksi Pasar terhadap Depresiasi Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 16 Desember 2014	49
4.4.2.	Pengujian Reaksi Pasar terhadap Depresiasi Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 12 Agustus 2015.....	51
4.4.3.	Pengujian Reaksi Pasar terhadap Depresiasi Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 29 September 2015.....	53
4.4.4.	Pengujian Reaksi Pasar terhadap Depresiasi Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 14 Desember 2015	55
4.5.	Pembahasan.....	57
4.6.	Hasil Diskusi	59
4.4.1.	Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 16 Desember 2014.....	59
4.4.2.	Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 12 Agustus 2015.....	61
4.4.3.	Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 29 September 2015.....	61
4.4.4.	Nilai Tukar Rupiah terhadap dollar AS tanggal 16 Desember 2014.....	63
BAB 5 KESIMPULAN dan SARAN		65
5.1.	Kesimpulan	65
5.2.	Implikasi Penelitian.....	66
5.3.	Keterbatasan Penelitian.....	67
5.4.	Saran Penelitian Lanjutan	68
DAFTAR PUSTAKA		69
LAMPIRAN.....		72