

## DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK .....	i
ABSTACT .....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN .....	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI.....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
I. Latar Belakang.....	1
II. Rumusan Masalah .....	4
III. Tujuan Penelitian .....	4
IV. Manfaat Penelitian .....	4
1. Manfaat Praktis .....	5
2. Manfaat Akademis.....	5
V. Sistematika Penulisan .....	5
BAB II. LANDASAN TEORI.....	8
I. Telaah Teoritis .....	8
1. Pasar Modal .....	9

2.	Hipotesis Pasar Efisien .....	9
3.	<i>Expected Return</i> .....	11
4.	<i>Actual Return</i> .....	12
5.	<i>Abnormal Return</i> .....	12
6.	Indeks Liquid 45.....	13
7.	Pemilihan Umum Legislatif Indonesia tahun 2014 .....	14
II.	Penelitian Terdahulu .....	15
III.	Kerangka Pemikiran.....	16
IV.	Perumusan Hipotesis .....	17
BAB III. METODE PENELITIAN .....		19
I.	Desain Penelitian .....	19
1.	Jenis Riset.....	19
2.	Dimensi Waktu.....	19
3.	Setting Riset.....	20
4.	Unit Analisis.....	20
II.	Populasi, Sampel, dan Teknik Sampling.....	20
1.	Populasi Penelitian .....	20
2.	Sampel dan Teknik Sampling.....	20
III.	Jenis Data.....	21
IV.	Definisi Variabel .....	21
1.	Pemilihan Umum Legislatif 2014 .....	21
2.	<i>Abnormal Return</i> .....	22
V.	Teknik Analisis Data.....	23

1. Uji Normalitas .....	23
2. Uji Homogenitas.....	23
3. Uji-T ( <i>T test</i> ).....	24
A. Pengujian Hipotesis 1 .....	24
B. Pengujian Hipotesis 2 .....	26
<b>BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>29</b>
I. Analisis Deskriptif.....	29
II. Pengujian Hipotesis .....	32
1. Pengujian Hipotesis 1 .....	34
2. Pengujian Hipotesis 2 .....	36
<b>BAB V. SIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>38</b>
I. Simpulan.....	38
II. Keterbatasan Penelitian .....	39
III. Saran .....	39

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

## DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel IV.1 Rata-rata dan Standar Deviasi <i>Abnormal Return</i> Harian .....	30
Tabel IV.2 Rata-rata <i>Abnormal Return</i> Harian .....	31
Tabel IV.3 Uji Normalitas Data Variabel <i>Abnormal Return</i> .....	32
Tabel IV.4 Uji Homogenitas Data Variabel <i>Abnormal Return</i> .....	33
Tabel IV.5 Uji Homogenitas Data Variabel <i>Abnormal Return</i> Setelah Dilakukan Transformasi Data .....	34
Tabel IV.6 Tabel T Hitung <i>Abnormal Return</i> Harian .....	34
Tabel IV.7 Tabel Uji T terhadap <i>Abnormal Return</i> Sebelum Peristiwa dan Setelah Peristiwa .....	37

## DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar II.1 Kerangka Pemikiran.....	16
Gambar IV.1 Diagram <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Setelah Peristiwa .....	30
Gambar IV.2 Grafik <i>Abnormal Return</i> Harian Selama Periode Peristiwa .....	35