

DAFTAR ISI

BAB 1	14
1.1 LATAR BELAKANG MASALAH.....	16
1.2 RUMUSAN MASALAH.....	23
1.3 TUJUAN PENELITIAN.....	24
1.4 MANFAT PENELITIAN.....	25
1.5 BATASAN PENELITIAN.....	25
1.6 SISTEMATIKA PENELITIAN.....	26
BAB II.....	28
2.1 EFISIENSI PASAR	28
2.2 PENGUJIAN EFISIENSI PASAR SECARA INFORMASI.....	31
2.3 <i>EVENT STUDY</i>	32
2.4 <i>RETURN</i>	36
2.4.1 <i>Abnormal Return</i>	36
2.4.2 <i>Expected Return</i>	37
2.4.3 <i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	39
2.4.4 <i>Cumulative Average Abnormal Return (CAAR)</i>	39
2.5 PENGEMBANGAN HIPOTESIS DAN PENELITIAN TERDAHULU....	39
2.5.1 PENELITIAN TERDAHULU DAN HIPOTESIS 1 (H1)	39
2.5.2 PENELITIAN TERDAHULU DAN HIPOTESIS 2 (H2)	42
2.5.3 PENELITIAN TERDAHULU DAN HIPOTESIS 3 (H3)	44
2.6 KERANGKA PEMIKIRAN TEORITIS	46
BAB III	47
3.1 DEFINISI OPERASIONAL VARIABEL	47
3.2 SUMBER DATA DAN JENIS DATA.....	47
3.3 PERIODE PENELITIAN DAN IDENTIFIKASI PERISTIWA	48
3.4 POPULASI DAN SAMPEL PENELITIAN.....	49
3.5 METODE ANALISIS DAN UJI HIPOTESIS	51
3.5.1 Metode Analisis.....	51
3.5.2 Uji Hipotesis 1	51

3.5.3 Uji Hipotesis 2	55
2.5.4 Uji Hipotesis 3	56
BAB I	57
4.1 DATA	57
4.2 DESKRIPSI STATISTIK	58
4.3 PENGUJIAN DAN ANALISIS HIPOTESIS 1	59
4.4 PENGUJIAN DAN ANALISIS HIPOTESIS 2	62
4.5 PENGUJIAN DAN ANALISIS HIPOTESIS 3	63
BAB V	67
5.1 KESIMPULAN	67
5.2 KETERBATASAN PENELITIAN	68
5.3 SARAN	68
DAFTAR PUSTAKA	70
LAMPIRAN	73