

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Pertanyaan Penelitian	8
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Ruang Lingkup Penelitian	9
1.7. Sistematika Penulisan	10
BAB II LANDASAN TEORI	12
2.1. Pasar Modal	12
2.2. Pasar Modal yang Efisien	13
2.2.1. Bentuk-bentuk Pasar Modal yang Efisien	13
2.2.2. Faktor-faktor yang Menyebabkan Pasar Menjadi Efisien atau Tidak Efisien	15
2.3. Studi Peristiwa	17
2.4. Abnormal Return	19
2.5. Return Ekspektasian	21

2.6. Pemilihan Umum Presiden Amerika Serikat	23
2.7. Indeks LQ45	23
2.8. Penelitian Sebelumnya	25
2.9. Hipotesis.....	28
BAB III METODA PENELITIAN	29
3.1. Desain Penelitian.....	29
3.2. Variabel Penelitian	30
3.3. Populasi dan Sampel	32
3.4. Instrumen Penelitian.....	34
3.5. Metode Pengumpulan Data	35
3.6. Metode Analisis Data.....	36
3.6.1. Langkah Pengujian Hipotesis I dan II.....	36
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	39
4.1. Deskripsi Data.....	39
4.1.1. Deskripsi Data pada Peristiwa Perpanjangan	40
4.1.2. Deskripsi Data pada Peristiwa Pergantian	42
4.2. Pengujian Hipotesis.....	44
4.2.1. Pengujian Hipotesis pada Peristiwa Perpanjangan	44
4.2.2. Pengujian Hipotesis pada Peristiwa Pergantian	46
4.3. Pembahasan.....	48
BAB V SIMPULAN	52
5.1. Simpulan	52
5.2. Implikasi.....	53
5.3. Keterbatasan.....	54
5.4. Saran.....	54
DAFTAR PUSTAKA	56
LAMPIRAN.....	59

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Periode Peristiwa Perpanjangan dan Peristiwa Pergantian	35
Tabel 4.1 Data Deskriptif AAR dan CAAR pada Peristiwa Perpanjangan	40
Tabel 4.2 Data Deskriptif AAR dan CAAR pada Peristiwa Pergantian	42
Tabel 4.3 Pengujian One sample T-test pada Variabel AAR.....	44
Tabel 4.4 Pengujian One sample T-test pada Variabel CAAR.....	45
Tabel 4.5 Pengujian One sample T-test pada Variabel AAR.....	46
Tabel 4.6 Pengujian One sample T-test pada Variabel CAAR.....	48

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Pengujian Kandungan Informasi Suatu Pengumuman.....	18
Gambar 2.2. Periode Estimasi dan Periode Jendela.....	22
Gambar 3.1 Periode Estimasi dan Periode Jendela pada Penelitian	34
Gambar 4.1 Rata-rata Abnormal Return dan Akumulasi Rata-rata Abnormal Return pada Peristiwa Perpanjangan.....	41
Gambar 4.2 Rata-rata Abnormal Return dan Akumulasi Rata-rata Abnormal Return pada Peristiwa Pergantian	43