

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN (F1)	ii
HALAMAN PERSETUJUAN (F2)	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI (F3).....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRACT	vii
INTISARI.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Manfaat Penelitian.....	7
1.5 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1 Pasar Modal.....	10
2.2 Hipotesis Pasar Efisien.....	11
2.3 <i>Abnormal Return</i>	12
2.4 <i>Actual Return</i>	13
2.5 <i>Expected Return</i>	13
2.6 Indeks Liquid-45 (ILQ-45).....	15

2.7 Studi Peristiwa.....	16
2.8 Penelitian Terdahulu.....	17
2.9 Kerangka Pemikiran.....	20
2.10 Perumusan Hipotesis.....	20
BAB III METODE PENELITIAN.....	22
3.1 Jenis Penelitian.....	22
3.2 Periode Penelitian.....	22
3.3 Populasi dan Sampel.....	23
3.4 Jenis dan Sumber Data.....	24
3.5 Definisi Operasional.....	24
3.6 Metode Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	26
3.6.1 Metode Analisis Data.....	26
3.6.2 Pengujian Hipotesis 1.....	26
3.6.3 Pengujian Hipotesis 2.....	29
BAB IV PEMBAHASAN.....	32
4.1 Analisis Deskriptif dan Uji Normalitas.....	33
4.2 Pengujian Hipotesis Pertama (H1).....	36
4.3 Pengujian Hipotesis Kedua (H2).....	38
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	41
5.1 Kesimpulan.....	41
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	42
5.3 Saran.....	42
DAFTAR PUSTAKA.....	44
LAMPIRAN.....	46

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Rata-rata dan Standar Deviasi <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Peristiwa.....	33
Tabel 4.2 Rata-rata <i>Abnormal Return</i> Harian	34
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas	35
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>One Sample T-Test</i> AAR Saham Indeks LQ-45.....	37
Tabel 4.5 Hasil Perhitungan Perbedaan <i>Average Abnormal Return</i> antara Sebelum dan Setelah Peristiwa	39

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Grafik AAR Selama Periode Peristiwa	36
-------------------------------------------------------------	----