

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penulisan	7
 BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Landasan Teori	9
2.1.1 Pasar Saham dan Volatilitasnya	9
2.1.2 Efisiensi Pasar Atas Ketersediaan Informasi	11
2.1.3 Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Pasar Saham Indonesia	14
2.1.4 Pajak	16
2.1.5 Pengampunan Pajak	18
2.1.6 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	22
2.1.7 Studi Empiris	24

2.2 Kajian Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis	25
BAB III METODA PENELITIAN	
3.1 Desain Penelitian	27
3.2 Metode Pengumpulan Data	27
3.3 Definisi Operasional Variabel	28
3.3.1 IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan)	28
3.3.2 Imbal Hasil (<i>Return</i>)	28
3.3.3 Transaksi Bersih Asing (<i>Foreign Net Transaction</i>)	29
3.4 Metoda Analisa Data	30
3.4.1 Statistik Deskriptif	30
3.4.2 Uji Asumsi Klasik	30
3.4.3 Uji Hipotesis	30
3.5 Penentuan Jendela Peristiwa	31
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1 Statistik Deskriptif	35
4.2 Uji Normalitas Pada Setiap Sektor Industri	38
4.3 Uji <i>Paired Sample T-Test</i> dan Uji <i>Wilcoxon Signed Ranks</i>	40
4.4 Uji <i>One Sample T-Test</i>	46
BAB V SIMPULAN	
5.1 Simpulan	50
5.2 Implikasi	51
5.3 Keterbatasan	51
5.4 Saran	51
DAFTAR PUSTAKA	