

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GRAFIK	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI.....	xiv
ABSTRACT	xv
BAB 1.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Tujuan Penelitian	6
1.4. Manfaat Penelitian	7
BAB 2.....	8
Landasan Teori dan Pengembangan Hipotesis.....	8
2.1. Landasan Teori	8
2.1.1. Pasar Modal	8
2.1.2. Indeks Kompas 100	9
2.1.3. Efisiensi Pasar Modal	11
2.1.4. Studi Peristiwa.....	12
2.2. Penelitian Terdahulu	13

2.3. Pengembangan Hipotesis	14
BAB 3	18
Metode Penelitian	18
3.1. Design Penelitian	18
3.2. Data dan Sampel	18
3.2.1. Jenis dan Sumber data	18
3.3. Pengukuran Variabel.....	20
3.4. Metode Analisa Data	24
BAB 4	31
4.1. Hasil Pengumpulan Data	31
4.2. Statistik Deskriptif	32
4.3. Uji Normalitas.....	33
4.3. Uji Hipotesis	35
4.3.1. Penambahan ke Dalam Indeks.....	35
4.3.2. Penghapusan dari Indeks	39
4.3.3. Perubahan Profitabilitas dan Likuiditas Terhadap Return Kumulatif Tak Normal	42
4.3.3.1. Uji Multikolienaritas.....	42
4.3.3.2. Uji Autokorelasi.....	43
4.3.3.3. Analisis Regresi Linier Berganda	45
4.3.3.4. Koefisien determinasi R^2	50
4.4. Diskusi dan Implikasi	50
BAB 5	54
Kesimpulan & Saran.....	54
5.2. Kesimpulan	54
5.2. Keterbatasan Penelitian.....	57
5.3. Saran	58
Daftar Pustaka	59
LAMPIRAN	61

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Statistik Deskriptif.....	31
Tabel 4.2 Uji Normalitas AAR dan CAAR.....	32
Tabel 4.3 Uji Normalitas CAR, Δ ROE, Δ TVA	33
Tabel 4.4 Signifikansi AAR dan CAR Masuk.....	36
Tabel 4.5 Signifikansi AAR dan CAR Keluar	39
Tabel 4.6 Uji Multikolinieritas.....	41
Tabel 4.7 Uji Autokorelasi Durbin Watson Test.....	42
Tabel 4.8 Analisis Regresi Linier Berganda Masuk Indeks.....	43
Tabel 4.9 Analisis Regresi Linier Berganda Keluar Indeks.....	46

DAFTAR GRAFIK

4-1 Grafik AAR Masuk Indeks.....	34
4-2 Grafik CAAR Masuk Indeks.....	35
4-3 Grafik AAR Keluar Indeks	38
4-4 Grafik CAAR Keluar Indeks.....	38

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Saham Masuk Indeks.....	58
Lampiran 2 Daftar Saham Keluar Indeks	59
Lampiran 3 Daftar Penutupan Indeks Harian dan Return Pasar	60
Lampiran 4 Daftar Harga Saham Masuk Indeks	64
Lampiran 5 Daftar Saham Keluar Indeks.....	70
Lampiran 6 Abnormal Return Saham Masuk Indeks.....	76
Lampiran 7 Abnormal Return Saham Keluar Indeks.....	80
Lampiran 8 Average Abnormal Return (AAR) dan Cumulative Average Abnormal Return (CAAR) Harian Saham Masuk Indeks.....	84
Lampiran 9 Average Abnormal Return (AAR) dan Cumulative Average Abnormal Return (CAAR) Harian Saham Masuk Indeks.....	85
Lampiran 10 Cumulative Abnormal Return (CAR) Masuk dan Keluar Indeks	86
Lampiran 11 Return On Equity (ROE).....	89
Lampiran 12 Trading Volume Activity (TVA).....	92

Lampiran 13 Signifikansi AAR dan CAR Masuk Indeks.....	95
Lampiran 14 Signifikansi AAR dan CAR Keluar Indeks.....	96
Lampiran 15 Statistik Deskriptif.....	97
Lampiran 16 Uji Multikolinearitas, Autokorelasi dan Regresi.....	98
Lampiran 17 Uji Normalitas.....	100