



## DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN .....	i
LEMBAR KEASLIAN SKRIPSI .....	iii
ABSTRAK.....	iv
<i>ABSTRACT</i> .....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
LEMBAR PERSEMBAHAN.....	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GRAFIK.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian .....	6
1.4 Manfaat penelitian.....	6
1.5 Batasan Penelitian .....	7
1.6 Sistematika Penulisan .....	7
BAB II LANDASAN TEORI .....	9
2.1 Efisiensi Pasar.....	9
2.2 Pasar Modal .....	11
2.3 <i>Expected Return</i> .....	12
2.4 <i>Actual Return</i> .....	13
2.5 <i>Abnormal Return</i> .....	14
2.6 Studi Peristiwa .....	15
2.7 Indeks LQ-45 (ILQ-45) .....	16
2.8 Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis.....	17
BAB III METODE PENELITIAN.....	20
3.1 Definisi Operasional Variabel.....	20
3.2 Periode Penelitian.....	20
3.3 Jenis dan Sumber Data.....	21
3.4 Populasi dan Sampel Penelitian.....	21
3.5 Metode Analisis dan Pengujian Hipotesis.....	23



3.5.1	Metode Analisis .....	23
3.5.2	Pengujian Hipotesis 1.....	23
3.5.3	Pengujian Hipotesis 2.....	26
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....		28
4.1	Analisis Deskriptif.....	28
4.2	Pengujian Hipotesis Pertama (H1) .....	32
4.3	Pengujian Hipotesis Kedua (H2).....	33
BAB V PENUTUP .....		35
5.1	Kesimpulan.....	35
5.2	Saran .....	35
DAFTAR PUSTAKA .....		36
LAMPIRAN .....		38
Lampiran 1 data <i>actual return</i> .....		38
Lampiran 2 data <i>expected return</i> .....		39
Lampiran 3 data <i>abnormal return</i> .....		40
Lampiran 4 data <i>t Table</i> .....		41
Lampiran 5 Hasil uji normalitas.....		44