

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	viii
ABSTRAKSI	x
ABSTRACT.....	xi
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR GAMBAR	1
DAFTAR TABEL.....	1
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Batasan Masalah.....	6
1.5 Kontribusi Penelitian	7
1.6 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II.....	10
LANDASAN TEORI.....	10
2.1 Pengertian Pasar Modal.....	10
2.1.1 Fungsi Pasar Modal.....	11
2.2 Investasi.....	12
2.2.1 Tujuan Investasi	13
2.2.2 Perilaku Investor	14
2.2.3 Return dan Abnormal Return	14
2.3 Pengertian Saham	18

2.4	Indeks LQ 45	19
2.5	Event Study	19
2.6	Penelitian Terdahulu.....	21
2.7	Kerangka Pemikiran	21
2.8	Perumusan Hipotesis	22
BAB III		24
METODE PENELITIAN.....		24
3.1	Populasi dan Sampel	24
3.2	Jenis dan Pengambilan Data.....	24
3.3	Definisi Operasional.....	25
3.4	Metode Analisis Data	26
3.5	Pengujian Hipotesis	29
3.5.2	Hipotesis II	30
BAB IV		31
ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN		31
4.1	Analisis Deskriptif.....	31
4.2	Pengujian Hipotesis 1	35
4.2.1	Uji asumsi	35
4.2.2	Uji one sample t-test.....	36
4.3	Pengujian Hipotesis 2.....	40
4.3.1	Uji Normalitas.....	40
4.3.2	Uji Homogenitas	41
4.3.3	Uji Paired T-Test.....	42
4.4	Pembahasan	43
BAB V.....		49
KESIMPULAN DAN SARAN.....		49
5.1	Kesimpulan.....	49
5.2	Keterbatasan Penelitian	51
5.3	Saran.....	51
DAFTAR PUSTAKA		53



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis Reaksi Pasar Modal Indonesia terhadap Peristiwa Kenaikan Harga Bahan Bakar Minyak Bersubsidi 28 Maret 2015

NADYA NOVITA SARI, Sumiyana, Dr., M.Si.

Universitas Gadjah Mada, 2015 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

LAMPIRAN.....	55
---------------	----

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. Kerangka Pemikiran Teoritis Penelitian	21
Gambar 2. <i>Estimation Period</i> , <i>Event Window</i> dan <i>Event Date</i> pengumuman kenaikan harga BBM	27
Gambar 3. Grafik <i>abnormal return</i>	34

DAFTAR TABEL

Tabel 1. Analisis Deskriptif	32
Tabel 2. Analisis Deskriptif <i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	33
Tabel 3. Uji Normalitas	35
Tabel 4. Uji <i>One Sample t-Test</i>	36
Tabel 5. Uji Normalitas	41
Tabel 6. Uji Homogenitas	41
Tabel 7. Uji <i>Paired t-Test</i>	42