

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAKSI	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
A. Landasan Teori.....	8
B. Penelitian Terdahulu	32
C. Persamaan dan Perbedaan dengan Penelitian Terdahulu	34
D. Pola Hubungan Antara Hari Pengamatan dan Variabel.....	37
E. Kerangka Penelitian	40
F. Hipotesis Penelitian.....	41
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis Penelitian.....	42

B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	42
C. Populasi.....	43
D. Sampel dan Teknik Sampling	44
E. Jenis Data Penelitian	46
F. Prosedur Pengambilan Data	46
G. Definisi Operasional Variabel.....	47
H. Teknik Analisis Data.....	49
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian	52
B. Pembahasan.....	59
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan	64
B. Saran.....	64
DAFTAR PUSTAKA	66
LAMPIRAN.....	68

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian terdahulu.....	32
Tabel 3.1 Kriteria Pengambilan Sampel	45
Tabel 4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	52
Tabel 4.2 Hasil Uji <i>One Sample t-Test Abnormal Return</i>	57
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Paired Samples t-Test Abnormal Return</i>	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	40
Gambar 3.1 Periode Pengamatan	43
Gambar 4.1 Grafik Rata-Rata <i>Abnormal Return</i>	55

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Sampel Perusahaan.....	69
Lampiran 2 Tanggal Penting Pengumuman Dividen.....	76
Lampiran 3 Daftar Harga Saham Penutupan	84
Lampiran 4 Daftar Harga Saham Indeks Sektor Manufaktur	92
Lampiran 5 <i>Return</i> Sesungguhnya.....	99
Lampiran 6 <i>Return</i> Ekspektasian	106
Lampiran 7 <i>Abnormal Return</i>	113
Lampiran 8 Hasil Analisis Statistik Deskriptif	120
Lampiran 9 Hasil Analisis <i>One Sample t-Test</i>	121
Lampiran 10 Hasil Analisis <i>Paired Samples t-Test</i>	122