

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA ILMIAH.....	iv
MOTTO.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	vii
ABSTRAKSI	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I: PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan Penelitian.....	10
D. Manfaat Penelitian.....	10
BAB II: TINJAUAN PUSTAKA	11
A. Landasan Teori.....	11
1. Pasar modal	11
2. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	11
3. Indeks LQ-45	12
4. Efisiensi pasar	13
5. Studi peristiwa	18
6. <i>Signaling theori</i>	19
7. Anomali pasar	20

8. <i>Return</i> saham	22
9. <i>Abnormal Return</i>	25
B. Penelitian Terdahulu.....	26
C. Kerangka Pemikiran	28
D. Hipotesis	30
BAB III: METODE PENELITIAN	32
A. Rancangan Penelitian	32
B. Periode Pengamatan	32
C. Populasi.....	33
D. Sampel dan Teknik Sampling	33
E. Jenis Data Penelitian.....	36
F. Metode Pengumpulan Data.....	36
G. Definisi Operasional Variabel.....	36
H. Teknik Analisis Data	39
BAB IV: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
A. Hasil Penelitian	45
B. Pembahasan.....	52
BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN	55
A. Kesimpulan	55
B. Saran	55
DAFTAR PUSTAKA	56
LAMPIRAN.....	58