

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMBUTAN.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO	vii
ABSTRAK	viii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I	
PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Permasalahan	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	7
BAB II	
TINJAUAN PUSTAKA	9
A. Landasan Teori.....	9
1. Pasar Modal	9
2. Saham	9
3. Risiko Saham.....	12
4. Dividen	16
5. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>).....	19
6. Kebijakan Dividen.....	19
7. <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH).....	21

8. Anomali Pasar	26
9. Event Study	26
10. <i>Return</i>	27
11. <i>Abnormal Return</i>	29
B. Penelitian Terdahulu	29
C. Kerangka Konseptual / Kerangka Penelitian	33
D. Hipotesis.....	35
BAB III	
METODE PENELITIAN.....	36
A. Rancangan Penelitian	36
B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	36
C. Populasi.....	37
D. Sampel dan Teknik Sampling	37
E. Klasifikasi Variabel Penelitian.....	40
F. Jenis Data Penelitian	40
G. Prosedur Pengambilan Data	41
H. Variabel Penelitian	41
I. Teknik Analisis Data.....	44
BAB IV	
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	46
A. Hasil Penelitian	46
B. Pembahasan.....	54
BAB V	
KESIMPULAN DAN SARAN.....	59
A. Kesimpulan	59
B. Saran.....	59
Daftar Pustaka	61
LAMPIRAN.....	64