

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAKSI	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A.Latar Belakang Permasalahan.....	1
B.Rumusan Masalah.....	9
C.Tujuan Penelitian	9
D.Manfaat Penelitian	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
A.Landasan Teori.....	11
1. <i>Return Saham</i>	11
2. <i>Abnormal Return</i>	12
3. <i>Efficient Market Hypothesis</i>	15
4 <i>Agency Theory</i>	19
5. Anomali Pasar	21
6. <i>Event study</i>	24
B.Penelitian Terdahulu	26
1. Penelitian Terdahulu.	26
2. Perbedaan Peneliti Terdahulu Dengan Penelitian Saat Ini.	27
C.Kerangka Pemikiran.....	29
D.Hipotesis Penelitian	30
BAB III METODE PENELITIAN	32
A.Rancangan Penelitian.....	32
B.Objek Waktu Penelitian	32

C.Populasi.....	33
D.Sampel Penelitian.....	33
E. Definisi Operasional Variable.....	34
F. Jenis Data Penelitian	36
G.Prosedur Pengambilan Data.....	37
H.Teknik Analisis Data.....	37
I. Pengujian hipotesis	38
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
A.Hasil penelitian	42
1. Statistik Deskriptif	42
2. Pengujian Hipotesis 1	44
3. Pengujian hepotesis 2.....	45
B.Pembahasan.....	46
1. <i>Abnormal return</i> sebelum dan sesudah Idul Fitri.	46
2. Perbedaan <i>abnormal return</i> sebelum dan sesudah Idul Fitri.	47
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	49
A.Kesimpulan	49
B.Saran	50
DAFTAR PUSTAKA	51