

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
Abstrak .....	i
<i>Abstract</i> .....	ii
Kata Pengantar .....	iii
Daftar Isi .....	vi
Daftar Tabel .....	ix
Daftar Gambar.....	x
Daftar Lampiran .....	xi
BAB 1 PENDAHULUAN .....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	7
1.4. Kegunaan Penelitian.....	7
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA .....	9
2.1. Landasan Teori .....	9
2.1.1. Pasar Modal Efisien .....	9
2.1.2. <i>Event Study</i> .....	11
2.1.3. <i>Actual Return</i> .....	12
2.1.4. <i>Expected Return</i> .....	13
2.1.5. <i>Abnormal Return</i> .....	14
2.2. Penelitian Terdahulu.....	15
2.3. Kerangka Pemikiran .....	18

2.4. Hipotesis .....	20
<b>BAB 3 METODE PENELITIAN .....</b>	<b>21</b>
3.1. Jenis Penelitian .....	21
3.2. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	21
3.3. Sumber Data .....	23
3.4. Tahapan Penelitian .....	23
3.4.1. Cara Pengumpulan Data.....	23
3.4.2. Populasi dan Sampel .....	23
3.4.3. Cara Pengukuran Data .....	27
<b>BAB 4 HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>31</b>
4.1. <i>Return Saham</i> .....	31
4.2. <i>Abnormal Return</i> .....	35
4.3. Pengujian Normalitas Data.....	38
4.4. Pengujian Hipotesis .....	40
4.4.1. Pengujian Hipotesis 1.....	40
4.4.2. Pengujian Hipotesis 2.....	44
4.5. Pembahasan .....	45
<b>BAB 5 PENUTUP .....</b>	<b>51</b>
5.1. Kesimpulan.....	51
5.2. Keterbatasan Penelitian .....	52
5.3. Saran Penelitian Selanjutnya .....	52

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

Universitas Tanjungpura