

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
<b>Halaman Judul .....</b>	<b>i</b>
<b>Halaman Persetujuan Pembimbing .....</b>	<b>ii</b>
<b>Halaman Pengesahan.....</b>	<b>iii</b>
<b>Halaman Persembahan .....</b>	<b>iv</b>
<b>Pernyataan Keaslian Karya .....</b>	<b>v</b>
<b>Abstraksi.....</b>	<b>vi</b>
<b>Kata Pengantar .....</b>	<b>vii</b>
<b>Daftar Isi .....</b>	<b>ix</b>
<b>Daftar Tabel .....</b>	<b>xii</b>
<b>Daftar Lampiran .....</b>	<b>xiii</b>
 <b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang .....	1
B. Perumusan Masalah .....	5
C. Tujuan Penelitian .....	5
D. Manfaat Penelitian .....	5
E. Metode Penelitian	
1. Jenis Penelitian.....	6
2. Jenis Data Penelitian .....	6
3. Sampel Penelitian.....	6

4. Teknik Pengumpulan Data.....	7
5. Hipotesis Penelitian .....	7
6. Teknik Analisis Data.....	7
F. Sistematika Penulisan .....	10
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b>	
A. Pengertian Pasar Modal .....	12
B. Definisi Investasi .....	14
C. Indeks Harga Saham dan Indeks Harga Saham Gabungan.....	15
D. Saham	
1. Definisi Saham.....	16
2. Jenis Saham.....	16
E. Return.....	18
F. Keuntungan dan Kerugian Kepemilikan Saham .....	19
G. Definisi Efisiensi Pasar .....	20
H. Studi Peristiwa .....	24
I. <i>Abnormal Return</i> .....	25
J. Penelitian Terdahulu .....	26
K. Hipotesis Penelitian .....	28
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
A. Jenis Penelitian.....	31
B. Jenis Data Penelitian .....	31
C. Sampel Penelitian.....	32
D. Teknik Pengumpulan Data.....	32

E. Teknik Analisis Data.....	32
<b>BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN</b>	
A. Statistik Deskriptif .....	42
B. Pengujian Hipotesis	
1. Uji Beda ( t-test ).....	43
2. Model Regresi .....	52
C. Uji Asumsi Klasik	
1. Uji Normalitas.....	55
2. Uji Heteroskedastisitas.....	56
3. Uji Korelasi .....	57
4. Uji Multikolonieritas.....	58
D. Pembahasan.....	59
<b>BAB V SIMPULAN, KETERBATASAN DAN SARAN</b>	
A. Simpulan .....	62
B. Keterbatasan dan Saran.....	62
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	

## DAFTAR TABEL

<b>Tabel 3. 1.</b> Pengambilan keputusan ada tidaknya autokorelasi.....	40
<b>Tabel 4. 1.</b> Rata-rata <i>abnormal return</i> selama periode jendela.....	42
<b>Tabel 4. 2.</b> Statistik deskriptif .....	43
<b>Tabel 4. 3.</b> Hasil pengujian normalitas data .....	44
<b>Tabel 4. 4.</b> Rekapitulasi uji t pada setiap periode jendela .....	51
<b>Tabel 4. 5.</b> Hasil uji hipotesis .....	53
<b>Tabel 4. 6.</b> Perbedaan rata-rata <i>abnormal return</i> .....	54
<b>Tabel 4. 7.</b> Uji normalitas.....	55
<b>Tabel 4. 8.</b> Uji heteroskedastisitas.....	57
<b>Tabel 4. 9.</b> Uji multikolonieritas .....	58

## DAFTAR LAMPIRAN

**Lampiran 1.** Data Indeks Harga Saham Gabungan

**Lampiran 2.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk.

**Lampiran 3.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Indosat Tbk.

**Lampiran 4.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Bakrie Telecom Tbk.

**Lampiran 5.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Exelcomindo Pratama Tbk.

**Lampiran 6.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Mobile-8 Telecom Tbk.

**Lampiran 7.** Harga saham dan *Expected Return* PT. Infoasia Teknologi Global Tbk.

**Lampiran 8.** *Abnormal Return* selama periode pengamatan.

**Lampiran 9.** Hasil output SPSS Versi 10.0.