

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iv
MOTO DAN PERSEMBAHAN	v
PERNYATAAN DAN ORISINALITAS SKRIPSI	vi
ABSTRAKSI	vii
ABSTRAKSION.....	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	7
E. Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Definisi Pasar Modal	9
B. Pengertian Saham	10

C. Jenis-Jenis Saham	10
D. Faktor-faktor yang mempengaruhi harga saham	12
E. Reaksi Pasar	14
F. Overreaction Hypothesis	14
G. Rumusan Hypothesis	16

BAB III METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	18
B. Populasi dan Teknik Penentuan Sampel	18
C. Data Penelitian	19
D. Teknik Pengumpulan Data	19
E. Variabel Penelitian	20
F. Pengukuran Variabel	20
G. Uji Kualitas Data	24
H. Teknik Analisis Data	24

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

A. Statistik Deskriptif	25
B. Pengujian Normalitas Data	33
C. Pengujian Hipotesis	34
D. Pembahasan Hasil Analisis	41

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	44
B. Keterbatasan Penelitian	44
C. Saran	45

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Prosedur Penentuan Sampel	25
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif	30
Tabel 4.2.1 Statistik Deskriptif	31
Tabel 4.2.2 Statistik Deskriptif	32
Tabel 4.3 Hasil Pengujian Normalitas	33
Tabel 4.4 Hasil Uji Beda (Independent Sample Test)	40

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Grafik AAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2009	35
Gambar 4.2 Grafik CAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2009	36
Gambar 4.3 Grafik AAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2010	36
Gambar 4.4 Grafik CAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2010	37
Gambar 4.5 Grafik AAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2011	38
Gambar 4.6 Grafik CAR Portofolio Winner dan Loser Tahun 2011	39

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Hasil Pengolahan Klasifikasi Sampel Penelitian

Lampiran 2 Hasil Uji Statistik Deskriptif

Lampiran 3 Hasil Uji Normalitas

Lampiran 4 Hasil Uji Independent Samples Test