

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Persetujuan Pembimbing	ii
Halaman Pengesahan	iii
Halaman Moto Dan Persembahan	iv
Pernyataan Keaslian Karya	v
Abstraksi	vi
Abstract	vii
Kata Pengantar	viii
Daftar Isi	x
Daftar Tabel	xiii
Daftar Lampiran	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
Latar Belakang	1
Rumusan Masalah	5
Tujuan Penelitian	5
Manfaat Penelitian	5
Sistematika Penelitian	6

BAB II LANDASAN TEORI

Landasan Teori.....	8
Pasar Modal.....	8
Efisiensi Pasar Modal.....	10
Hipotesis Pasar Efisien.....	11
Teori Portofolio.....	13
Strategi Portofolio.....	13
Anomali Pasar Modal.....	16
Ringkasan Penelitian Terdahulu.....	19
Kerangka Teoritis.....	22
Hipotesis Dan Pengembangannya.....	22

BAB III METODE PENELITIAN

Jenis Penelitian.....	25
Populasi Dan Sampel.....	25
Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	26
Teknik Pengumpulan Data.....	27
Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	27
Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	31
Statistik Deskriptif.....	31
Uji Normalitas.....	32
Uji Beda (one sample t-tes).....	32
Langkah-langkah pengujian hipotesis.....	33

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

Penentuan Jumlah Sampel.....	35
Statistik Deskriptif.....	37
Uji Normalitas.....	37
Uji Hipotesis.....	38
Pengujian <i>ACAR winner</i> dan <i>loser</i> triwulan.....	38
Pengujian <i>ACAR winner</i> dan <i>loser</i> semester.....	40
Pengujian <i>ACAR winner</i> dan <i>loser</i> tahunan.....	42

Pengujian <i>abnormal profit</i>	44
Rangkuman hasil uji hipotesis.....	46
Pembahasan.....	48
Implikasi Penelitian.....	50

BAB V SIMPULAN, KETERBATASAN DAN SARAN

Kesimpulan	51
Keterbatasan dan Saran	51

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Tabulasi Hasil Penelitian Terdahulu	14
Tabel 4.1 Sampel Penelitian.....	36
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	37
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas	37
Tabel 4.4 <i>Cumulative Abnormal Return</i> Rata-Rata Saham <i>Winner</i> dan <i>Loser</i> per Triwulan.....	38
Tabel 4.5 <i>Cumulative Abnormal Return</i> Rata-Rata Saham <i>Winner</i> dan <i>Loser</i> per Semester.....	40
Tabel 4.6 <i>Cumulative Abnormal Return</i> Rata-Rata Saham <i>Winner</i> dan <i>Loser</i> per Tahunan.....	42
Tabel 4.7 <i>Abnormal profit</i> triwulan, semester dan tahunan	44
Tabel 4.8 Hasil Uji Hipotesis	46

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2007-2011
- Lampiran 2 Daftar Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama 5 tahun berturut-turut dalam periode penelitian (tahun 2007-2011)
- Lampiran 3 Portofolio Saham *Winner* dan *Loser* Periode Triwulan
- Lampiran 4 Portofolio Saham *Winner* dan *Loser* Periode Semester
- Lampiran 5 Portofolio Saham *Winner* dan *Loser* Periode Tahunan
- Lampiran 6 Kartu Bimbingan Skripsi Mahasiswa STIE MUSI