

DAFTAR ISI

Halaman judul	
Halaman Persetujuan Pembimbing	ii
Halaman Pengesahan	iii
Motto dan Persembahan	iv
Pernyataan Keaslian Karya	v
Pernyataan persetujuan unggah karya	vi
Abstraksi	vii
Abstract	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar isi	xii
Daftar Tabel	xv
Daftar lampiran	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Perumusan Masalah	10
C. Tujuan Penelitian	10
D. Manfaat Penelitian	11
E. Sistematika Pnelitian.....	11

BAB II	LANDASAN TEORI	13
A.	Indeks	13
1.	Definisi Indeks	13
2.	Kegunaan Angka Indeks.....	13
B.	Indeks harga saham	14
1.	Definisi Indeks Harga Saham	14
2.	Macam-macam Indeks Harga Saham	14
C.	Mekanisme Indeks LQ45	18
D.	Kandungan Informasi Terkait Pengumuman Saham	
	Perusahaan di Indeks Bursa Efek	19
E.	<i>Signaling theory</i>	19
F.	Efisiensi Pasar	20
1.	Definisi Efisiensi Pasar	20
2.	Bentuk-bentuk Efisiensi Pasar	20
3.	Hipotesis Pasar Efisien	22
G.	<i>Abnormal Return</i>	22
H.	Penelitian Terdahulu	23
I.	Pengembangan Hipotesis	24
BAB III	METODE PENELITIAN	26
A.	Jenis Penelitian	26
B.	Populasi dan Sampel	26
C.	Jenis dan Sumber Data	27

D.	Teknik Pengumpulan Data	28
E.	Variabel Penelitian	28
F.	Teknik Analisis Data	34
1.	Statistik Deskriptif	34
2.	Pengujian Hipotesis	34
G.	Tabel Operasional Variabel Penelitian	35
BAB IV	HASIL DAN PERMBAHASAN	36
A.	Sampel Data Pnelitian	36
B.	Reaksi Pasar Atas Pengumuman Pergantian Saham Perusahaan	37
C.	Statistik Deskriptif	38
D.	Pengujian Hipotesis	40
BAB	SIMPULAN DAN SARAN	42
A.	Simpulan	42
B.	Saran	43

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Saham Perusahaan yang masuk dan Keluar dari Indeks LQ45	4
Tabel 1.2 perbedaan harga saham sebelum dan sesudah masuk kedalam Indeks LQ45.....	5
Tabel 1.3 perbedaan harga saham sebelum dan sesudah keluar dari Indeks LQ45	7
Tabel 4.1 Tabel Jumlah Sampel Penelitian	36
Tabel 4.2 Tabel Statistik Deskriptif Perusahaan yang Masuk	38
Tabel 4.3 Tabel Statistik Deskriptif Perusahaan yang Keluar	39
Tabel 4.4 Pengujian <i>one sample t-test</i> perusahaan yang Masuk kedalam Indeks	40
Tabel 4.5 Pengujian <i>one sample t-test</i> perusahaan yang Keluar dari Indeks	41

Lampiran

Lampiran 1 : tanggal pengumuman penggantian saham perusahaan

Lampiran 2 : daftar penggantian saham perusahaan

Lampiran 3 : Hasil penghitungan

Lampiran 4: Daftar harga saham

Lampiran 5 : Kartu bimbingan