

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	4
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Sistematika Penulisan	6
BAB II. DESKRIPSI OBJEK PENELITIAN	8
2.1 Sejarah Pasar Modal Indonesia	8
2.1.1 Jaman Penjajahan	8
2.1.2 Perang Dunia II	10

2.1.3	Jaman Orde Lama	10
2.1.4	Jaman Orde Baru	11
2.2	Pasar Modal Indonesia	14
2.3	Jenis Pasar Modal	15
2.4	Lembaga yang Terkait dengan Pasar Modal	16
2.4.1	BAPEPAM	16
2.4.2	Instansi Pemerintah	16
2.4.3	Lembaga Swasta	17
2.4.4	Badan Penilai (<i>Appraiser</i>)	17
2.4.5	Konsultan Efek (<i>Investment Advisor</i>)	18

BAB III KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN, DAN

HIPOTESIS	19
3.1 Kajian Pustaka	19
3.1.1 Peran Pasar Modal	19
3.1.2 Efisiensi Pasar Modal	20
3.1.3 Informasi di Pasar Modal	22
3.1.4 Saham	23
3.1.5 <i>Event Study</i>	27
3.1.6 <i>Abnormal Return</i>	28
3.1.7 <i>Trading Value Activity</i>	30
3.1.8 Penelitian Terdahulu	30

3.2	Kerangka Pemikiran	33
3.3	Hipotesis	34
BAB IV METODE RISET		36
4.1	Objek Riset	36
4.2	Periode Riset	36
4.3	Metode Riset	37
4.4	Metode Pengumpulan Data	38
4.5	Metode Pengolahan Data	39
4.5.1	Metode Kuantitatif	39
4.6	Asumsi-asumsi	41
4.7	Alat Analisis Yang Digunakan	41
BAB V HASIL DAN ANALISIS		43
5.1	Deskripsi Data	43
5.2	Pengujian Hipotesis	43
5.2.1	Pengujian Hipotesis 1	44
5.2.2	Pengujian Hipotesis 2	44
5.2.3	Pengujian Hipotesis 3	47
5.3	Analisis Hasil	50

BAB VI KESIMPULAN DAN REKOMENDASI	51
6.1 Kesimpulan	51
6.2 Rekomendasi	52
DAFTAR PUSTAKA	53
LAMPIRAN	54
RIWAYAT HIDUP	88

