

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN JUDUL BELAKANG	iii
PERNYATAAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
RIWAYAT HIDUP	iv
PERSEMBAHAN	vi
MOTTO	viii
INTISARI	viii
ABSTRACT	ix
PRAKATA	ix
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Ruang Lingkup Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1 Teori Pasar Efisien	9
2.2 <i>Event Study</i>	9
2.3 Harga Saham	11
2.4 <i>Return Saham</i>	11
2.5 <i>Expected Return</i>	13
2.6 <i>Abnormal Return</i>	14
2.7 Penelitian Terdahulu	17
2.8 Kerangka Pemikiran	20

2.9 Pengembangan Hipotesis.....	20
BAB III METODE PENELITIAN.....	22
3.1 Jenis Penelitian.....	22
3.2 Jenis dan Sumber Data	22
3.3 Populasi dan Sampel.....	23
3.4 Definisi Operasional Variabel Penelitian	24
3.5 Metode Analisis Data	26
3.5.2 Uji Normalitas	26
3.5.3 Pengujian Hipotesis	26
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	28
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	28
4.2 Analisis Statistik Deskriptif	29
4.3 Uji Normalitas.....	29
4.4 Uji Paired Sample T-Test	32
4.5 Pembahasan Hasil Penelitian	32
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	34
5.1 Kesimpulan	34
5.2 Keterbatasan Penelitian	34
5.3 Saran	35
DAFTAR PUSTAKA.....	36
LAMPIRAN.....	38

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	17
Tabel 3. 1 Kriteria Sampel Perusahaan	24
Tabel 4. 1 Uji Statistik Deskriptif Average Abnormal Return	29
Tabel 4. 2 Uji Normalitas.....	31
Tabel 4. 3 Uji Paired Sampel T-Test	32

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Grafik Perbandingan Harga Saham Unilever, McDonalds, Starbucks, dan Danone.....	4
Gambar 1. 2 Harga Saham Sub Sektor Minyak dan Gas Bumi pada Masa Sebelum dan Saat Perang Rusia dan Ukraina.....	5
Gambar 2. 1 Kerangka Pemikiran.....	20
Gambar 3. 1 Event Window.....	23

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Sampel Penelitian	38
Lampiran 2 Indeks Harga Saham.....	39
Lampiran 3 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	41
Lampiran 4 Hasil Uji Normalitas.....	41
Lampiran 5 Hasil Uji Paired Sampel T-Test	41