

## DAFTAR ISI

|  | Halaman     |
|--|-------------|
| <b>HALAMAN JUDUL .....</b>             | <b>i</b>    |
| <b>PERNYATAAN.....</b>                 | <b>ii</b>   |
| <b>HALAMAN PERSETUJUAN .....</b>       | <b>iii</b>  |
| <b>HALAMAN PENGESAHAN .....</b>        | <b>iv</b>   |
| <b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP .....</b>      | <b>v</b>    |
| <b>PERSEMBAHAN .....</b>               | <b>vi</b>   |
| <b>MOTTO .....</b>                     | <b>vii</b>  |
| <b>ABSTRACT .....</b>                  | <b>viii</b> |
| <b>ABSTRAK .....</b>                   | <b>ix</b>   |
| <b>KATA PENGANTAR .....</b>            | <b>ix</b>   |
| <b>DAFTAR ISI .....</b>                | <b>xi</b>   |
| <b>DAFTAR TABEL .....</b>              | <b>xiv</b>  |
| <b>DAFTAR GAMBAR.....</b>              | <b>xv</b>   |
| <br>                                   |             |
| <b>BAB 1 PENDAHULUAN</b>               |             |
| 1.1. Latar Belakang Masalah .....      | 1           |
| 1.2. Perumusan Masalah .....           | 4           |
| 1.3. Tujuan Penelitian .....           | 5           |
| 1.4. Ruang Lingkup Penelitian.....     | 5           |
| 1.5. Manfaat Penelitian .....          | 5           |
| 1.6. Sistematika Penulisan .....       | 6           |
| <br>                                   |             |
| <b>BAB II LANDASAN TEORI</b>           |             |
| 2.1. Efisiensi Pasar.....              | 7           |
| 2.1.1. Tingkatan Efisiensi Pasar ..... | 9           |
| 2.1.2. Bentuk Efisiensi Pasar .....    | 10          |
| 2.1.3. Hubungan Efisiensi Pasar.....   | 10          |
| 2.2. Pasar Modal .....                 | 11          |
| 2.2.1. Pengertian Pasar Modal.....     | 11          |

|   |    |
|---|----|
| 2.2.2. Jenis Pasar Modal .....          | 11 |
| 2.2.3. Instrument Pasar Modal.....      | 12 |
| 2.3. Saham .....                        | 13 |
| 2.3.1. Pengertian Saham .....           | 13 |
| 2.3.2. Jenis Saham .....                | 14 |
| 2.3.3. Return Saham .....               | 14 |
| 2.3.4. Pengehitungan Return Saham ..... | 15 |
| 2.3.5. Resiko Saham .....               | 17 |
| 2.3.6. Jenis Resiko Saham .....         | 17 |
| 2.3.7. Penghitungan Resiko Saham .....  | 18 |
| 2.4. Corporate Action.....              | 20 |
| 2.4.1. Pengetian Corporate Action ..... | 20 |
| 2.4.2. Pengertian Stock Split .....     | 21 |
| 2.4.3. Tujuan Stock Split.....          | 22 |
| 2.4.4. Jenis Stock Split .....          | 22 |
| 2.5. Event Study.....                   | 24 |
| 2.6. Tinjauan Empiris.....              | 25 |
| 2.7. Kerangka Pikir .....               | 27 |
| 2.8. Hipotesis .....                    | 28 |

### **BAB III METODOLOGI PENELITIAN**

|   |    |
|---|----|
| 3.1. Jenis Penelitian.....                  | 29 |
| 3.2. Sumber Data.....                       | 29 |
| 3.3. Metode Pengumpulan Data.....           | 29 |
| 3.4. Populasi dan sample .....              | 30 |
| 3.4.1 Populasi .....                        | 30 |
| 3.4.2 Sample .....                          | 31 |
| 3.5. Teknik Analisis Data.....              | 32 |
| 3.6.1 Perhitungan Variabel Penelitian ..... | 32 |
| 3.6.2 Uji Prasyarat Data.....               | 34 |
| 3.6.3 Pengujian Hipotesis .....             | 36 |

## **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

|                                       |    |
|---------------------------------------|----|
| 4.1. Deskripsi Objek dan Data .....   | 37 |
| 4.1.1. Deskripsi Objek .....          | 37 |
| 4.2. Hasil Teknik Analisis Data ..... | 43 |
| 4.2.1 Hasil Perhitungan Variabel..... | 43 |
| 4.2.2 Hasil Uji Prasyarat Data .....  | 52 |
| 4.2.3 Hasil Uji Hipotesis .....       | 54 |
| 4.3. Pembahasan.....                  | 57 |

## **BAB V SIMPULAN DAN SARAN**

|                     |    |
|---------------------|----|
| 5.1. Simpulan ..... | 62 |
| 5.2. Saran .....    | 62 |

## **DAFTAR PUSTAKA**

## **LAMPIRAN**