

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN	vii
PEDOMAN TRANSLITASI ARAB-LATIN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori.....	10
1. Teori <i>Efficient Market Hypothesis</i>	10
2. <i>Event Studies</i>	14
3. Pasar Modal	17
4. Saham.....	21
5. Harga Saham.....	24
6. Indeks Harga Saham	25
7. Invasi.....	26
B. Penelitian Terdahulu.....	27
C. Kerangka Berfikir	29
D. Hipotesis Penelitian.....	30
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan.....	32
B. Populasi dan Sampel.....	32
C. Identifikasi Variabel	33
D. Definisi Operasional Variabel	34
E. Teknik Pengumpulan Data	35
F. Teknik Analisis Data	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian.....	38
B. Pembahasan	58

BAB V PENUTUP

A. Kesimpulan.....	68
B. Keterbatasan Penelitian	69
C. Saran	69

**DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN-LAMPIRAN**



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1	Populasi.....	32
Tabel 3.2	Variabel Operasional.....	34
Tabel 4.1	Data Historis IHSG	38
Tabel 4.2	Hasil Statistik Deskriptif IHSG.....	39
Tabel 4.3	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> IHSG	41
Tabel 4.4	<i>Output Paired SaMple T-test</i> IHSG	42
Tabel 4.5	Data Historis KLCI	42
Tabel 4.6	Hasil Statistik Deskriptif KLCI.....	43
Tabel 4.7	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> KLCI	45
Tabel 4.8	<i>Output Paired Sample T-test</i> KLCI	45
Tabel 4.9	Data Historis SET	46
Tabel 4.10	Hasil Statistik Deskriptif SET	46
Tabel 4.11	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> SET	48
Tabel 4.12	<i>Output Paired Sample T-test</i> SET.....	48
Tabel 4.13	Data Historis PSEI	49
Tabel 4.14	Hasil Statistik Deskriptif PSEI.....	49
Tabel 4.15	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> PSEI	51
Tabel 4.16	<i>Output Wilcoxon Signed Ranks Test</i> PSEI.....	51
Tabel 4.17	Data Historis VNI	52
Tabel 4.18	Hasil Statistik Deskriptif VNI.....	52
Tabel 4.19	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> VNI	54
Tabel 4.20	<i>Output Wilcoxon Signed Ranks Test</i> VNI	54
Tabel 4.21	Data Historis STI	55
Tabel 4.22	Hasil Statistik Deskriptif STI.....	56
Tabel 4.23	Hasil Uji Normalitas <i>Shapiro Wilk</i> STI	57
Tabel 4.24	<i>Output Wilcoxon Signed Ranks Test</i> STI	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Tingkat Kumulatif Bentuk Pasar Efisien	14
Gambar 2.2 Kerangka Berfikir	30
Gambar 3.1 Periode Pengamatan.....	33
Gambar 4.1 Grafik Harga IHSG.....	40
Gambar 4.2 Grafik Harga KLCI.....	44
Gambar 4.3 Grafik Harga SET	47
Gambar 4.4 Grafik Harga PSEI.....	50
Gambar 4.5 Grafik Harga VNI.....	53
Gambar 4.6 Grafik Harga STI.....	56

