# DAFTAR ISI

**ABSTRAK**……..... i
**KATA PENGANTAR**……..... ii
**DAFTAR ISI**……..... v
**DAFTAR TABEL**……..... ix
**DAFTAR GAMBAR**…… xi
**DAFTAR LAMPIRAN**..... xii

**BAB I PENDAHULUAN**
1.1 Latar Belakang Penelitian..... 1
1.2 Identifikasi Masalah..... 4
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian..... 5
1.3.1 Maksud Penelitian ..... 5
1.3.2 Tujuan Penelitian ……..... 5
1.4 Pembatasan Masalah……. 5
1.5 Kerangka Pemikiran ……. 5
1.6 Kegunaan Penelitian ……. 9
1.7 Metode Penelitian ……. 10
1.8 Lokasi Penelitian……... 11

**BAB II TINJAUAN PUSTAKA**
2.1 Pasar Modal…… 12
2.1.1 Definisi Pasar Modal…… 12
2.1.2 Tujuan Pasar Modal…….. 13
2.1.3 Manfaat Pasar Modal…… 14
2.1.4 Jenis-jenis Pasar Modal…… 15
2.1.5 Keuntungan dan Kerugian Investasi di Pasar Modal…… 15
2.1.5.1 Keuntungan Investasi di Pasar Modal……..... 15

PDF created with FinePrint pdfFactory Pro trial version http://www.fineprint.com

2.1.5.2 Kerugian Investasi di Pasar Modal…… 16
2.1.6 Sejarah Pasar Modal……. 16
2.2 Efisiensi Pasar Modal…… 18
2.2.1 Definisi Efisiensi Pasar Modal……. 18
2.2.2 Jenis Efisiensi Pasar Modal…….. 18
2.2.3 Pengujian Efisiensi Pasar……. 19
2.3 Informasi…… 20
2.3.1 Definisi Informasi …… 20
2.3.2 Karakteristik Kualitas Informasi…….. 21
2.4 Investasi …… 21
2.4.1 Definisi Investasi…….. 21
2.4.2 Tujuan Investasi…… 22
2.4.3 Analisis Investasi ……. 23
2.4.4 Strategi Investasi…….. 23
2.4.4.1 Strategi Investasi Pasif……. 23
2.4.4.2 Strategi Investasi Aktif…….. 24
2.5 Saham ……... 24
2.5.1 Definisi Saham……. 24
2.5.2 Jenis Saham…….. 25
2.5.3 Manfaat Kepemilikan Saham ……. 27
2.5.4 Taksiran Nilai Saham…… 28
2.5.5 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham…… 28
2.5.6 Risiko dan Return Saham……. 29
2.5.6.1 Risiko Saham…… 29
2.5.6.2 Return Saham…… 30
2.5.7 Indeks Harga Saham……. 31
2.5.7.1 Definisi Indeks Harga Saham …….. 31
2.5.7.2 Jenis Indeks Harga Saham…… 32
2.5.7.3 Metode Perhitungan Indeks Harga Saham…… 32
2.5.7.4 Indeks Harga Saham Gabungan…… 33
2.6 Aksi Korporasi …….. 34

PDF created with FinePrint pdfFactory Pro trial version http://www.fineprint.com

2.6.1 Definisi Aksi Korporasi…… 34
2.6.2 Landasan Hukum Pelaksanaan Aksi Korporasi…… 34
2.7 Stock Split……. 35
2.7.1 Definisi Stock Split …… 35
2.7.2 Syarat-syarat Stock Split …… 36
2.8 Earning Per Share (EPS) dan Dividend Yield……... 37
2.8.1 Earning Per Share (EPS)…….. 37
2.8.2 Dividend Yield……. 38

**BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN**
3.1 Objek Penelitian…… 40
3.2 Metode Penelitian ……. 41
3.2.1 Operasionalisasi Variabel……. 41
3.2.2 Jenis dan Sumber Data……. 42
3.2.2.1 Jenis Data……. 42
3.2.2.2 Sumber Data …… 43
3.2.3 Teknik Pengumpulan Data…… 43
3.3 Teknik Pengolahan dan Analisis Data …….. 43
3.4 Rancangan Uji Hipotesis…… 44
3.4.1 Penetapan Hipotesis Nol dan Hipotesis Alternatif ……... 44
3.4.2 Pemilihan Uji Statistik dan Penghitungan Nilai Test Statistik……. 45
3.4.3 Penetapan Tingkat Signifikansi…… 49

**BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**
4.1 Hasil Penelitian ……. 50
4.1.1 Gambaran Umum Perusahaan…….. 50
4.1.2 Hasil Pengolahan dan Analisis Data …… 55
4.1.3 Pengujian Hipotesis…….. 57
4.1.3.1 Uji Normalitas…….. 57
4.1.3.2 Pengujian Signifikansi…….. 59

PDF created with FinePrint pdfFactory Pro trial version http://www.fineprint.com

4.2 Pembahasan…… 67
4.2.1 Rata-rata Abnormal Return…….. 68
4.2.2 Rata-rata Perubahan Earning…… 68
4.2.3 Rata-rata Perubahan Dividend Yield…… 71

**BAB V KESIMPULAN DAN SARAN**
5.1 Kesimpulan…… 73
5.2 Saran …… 74

**DAFTAR PUSTAKA**
**LAMPIRAN**

PDF created with FinePrint pdfFactory Pro trial version http://www.fineprint.com