

DAFTAR ISI

BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Tinjauan Terhadap Objek Studi	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	4
1.3 Rumusan Masalah	13
1.4 Tujuan Penelitian.....	14
1.5 Kegunaan Penelitian.....	14
1.6 Sistematika Penulisan.....	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	16
2.1 Perusahaan.....	16
2.2 Investasi.....	17
2.3 Pasar Modal.....	18
2.4 Saham.....	21
2.5.2 Risiko Saham.....	21
2.5.3 Keuntungan Saham – <i>Capital Gain</i>	22
2.5 Dividen.....	24
2.6.1 Pengertian Dividen.....	24
2.6.2 Jenis Dividen	25

2.6.3	Kebijakan Dividen.....	26
2.6.4	Prosedur Pembagian Dividen	29
2.6	Indeks Harga Saham.....	30
2.7.1	Pengertian Indeks Harga Saham.....	30
2.7.2	Fungsi Indeks	30
2.7.3	Daftar Indeks di BEI.....	31
2.7.4	Persyaratan Indeks LQ45	32
2.7	<i>Return Saham</i>	33
2.8.1	<i>Return Realisasi</i>	34
2.8.2	<i>Abnormal Return</i>	35
2.8.3	<i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	35
2.8.4	<i>Cummulative Abnormal Return (CAR)</i>	36
2.8.5	<i>Cummulative Average Abnormal Return (CAAR)</i>	36
2.8	Referensi Penelitian.....	36
2.9	Kerangka Pemikiran.....	41
2.10	Hipotesis Penelitian.....	44
BAB III METODE PENELITIAN		45

3.1	Jenis dan Sumber Data Penelitian	45
3.2	Teknik Pengambilan Sampel.....	46
3.3	Operasionalisasi Variabel dan Skala Pengukuran ..	47
3.4	Data dan Teknik Pengumpulan	50
3.5	Analisis Data dan Uji Hipotesis	51
3.6	Event Study	55
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		57
4.1	Metode Perhitungan Data.....	57
4.2	Analisis Pengumuman Dividen Naik Keseluruhan pada Perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ45	59
4.3	Analisis Pengumuman Dividen Turun Keseluruhan pada Perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ45	63
4.4	Analisis Parsial Pengumuman Dividen Naik pada Perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ45.....	66
4.5	Analisis Parsial Pengumuman Dividen Turun pada Perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ45.....	70
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		75
5.1	Kesimpulan.....	75
5.2	Saran.....	77
5.3	Keterbatasan Penelitian	77
DAFTAR PUSTAKA.....		79