

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN PEMBIMBING	i
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN PENGUJI	v
KATA PENGANTAR.....	viii
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS	x
ABSTRAK	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
DAFTAR ISI	xiii
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR GAMBAR	xviii
DAFTAR LAMPIRAN	xx
BAB I PENDAHULUAN	21
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian	21
1.2. Latar Belakang Penelitian	23
1.3. Perumusan Masalah	32
1.4. Tujuan Penelitian.....	33
1.5. Manfaat Penelitian	33
1.5.1. Aspek Teoritis.....	33
1.5.2. Aspek Praktis.....	33
1.6. Sistematika Penulisan.....	34
BAB II TINJAUAN PUSTAKA PENELITIAN	37
2.1. Tinjauan Pustaka Penelitian	37
2.1.1. Rangkuman Teori	37
2.1.2. Penelitian Terdahulu.....	51
2.2. Kerangka Pemikiran.....	61
2.3. Hipotesis Penelitian.....	63
2.4. Ruang Lingkup Penelitian.....	64

2.4.1. Ruang Lingkup Substansial (Substantive Scope).....	64
2.4.2. Ruang Lingkup Waktu (Time Scope)	65
2.4.3. Ruang Lingkup Objek (Object Scope)	66
2.4.4. Ruang Lingkup Metodologis (Methodological Scope)	67
BAB III METODE PENELITIAN	68
3.1. Jenis Penelitian	68
3.2. Operasional Variabel dan Skala Pengukuran.....	68
3.3. Tahapan Penelitian.....	70
3.4. Populasi dan Sampel.....	72
3.4.1. Populasi	72
3.4.2. Sampel	73
3.5. Pengumpulan Data.....	74
3.5.1. Jenis dan Sumber Data	74
3.5.2. Teknik Pengumpulan Data.....	75
3.5.3. Keabsahan Data	75
3.6. Teknik Analisis dan Pengujian Hipotesis	76
3.6.1. Statistik Deskriptif.....	76
3.6.2. Penghitungan Return Harian Saham.....	76
3.6.3. Estimasi Return Normal	78
3.6.4. Analisis Harga Saham.....	80
3.6.5. Penghitungan Abnormal Return (AR)	81
3.6.6. Penghitungan Cumulative Abnormal Return (CAR).....	83
3.6.7. Volume Perdagangan Saham	84
3.6.8. Risiko Saham.....	86
3.6.9. Uji Normalitas Data.....	88
3.6.10. Pengujian Hipotesis	89
3.6.11. Kriteria Pengujian.....	91
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	93
4.1. Hasil Statistik Deskriptif Data Saham	93

4.2. Hasil Perhitungan Return Harian Saham	96
4.3. Hasil Estimasi Return Normal	99
4.4. Hasil Penghitungan Abnormal Return (AR)	102
4.5. Hasil Cumulative Abnormal Return (CAR).....	104
4.6. Hasil Analisis Volume Perdagangan Saham.....	107
4.7. Hasil Pengukuran Risiko Saham.....	109
4.8. Hasil Uji Normalitas Data.....	110
4.8.1. Hasil Uji Normalitas Harga Saham.....	111
4.8.2. Hasil Uji Normalitas AR.....	113
4.8.3. Hasil Uji Normalitas CAR	115
4.8.4. Hasil Uji Normalitas Volume	117
4.8.5. Hasil Uji Normalitas Risiko	119
4.8.6. Ringkasan Pemetaan Distribusi Data dan Jenis Uji	122
4.9. Hasil Pengujian Hipotesis	123
4.9.1. Hasil Uji Hipotesis 1: Harga Saham	123
4.9.2. Hasil Uji Hipotesis 2: Abnormal Return (AR).....	125
4.9.3. Hasil Uji Hipotesis 3: Cumulative Abnormal Return (CAR)	126
4.9.4. Hasil Uji Hipotesis 4: Volume Perdagangan	128
4.9.5. Hasil Uji Hipotesis 5: Risiko Saham.....	129
4.10. Pembahasan Hasil Penelitian	131
4.10.1. Harga Saham Sebelum dan Sesudah Peluncuran Danantara	131
4.10.2. Abnormal Return Saham Sebelum dan Sesudah Peluncuran Danantara	133
4.10.3. Cumulative Abnormal Return Saham Sebelum dan Sesudah Peluncuran Danantara	135
4.10.4. Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah Peluncuran Danantara	136
4.10.5. Risiko Saham Sebelum dan Sesudah Peluncuran Danantara	138
4.10.6. Sensitivitas Pasar dan Dukungan Kebijakan.....	140

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	141
5.1. Kesimpulan.....	141
5.2. Saran	143
5.2.1. Aspek Teoritis	143
5.2.2. Aspek Praktis	144
DAFTAR PUSTAKA	146
LAMPIRAN	161
Lampiran A – Data Historis Saham	161
Lampiran B – Hasil Uji Hipotesis	165