

DAFTAR ISI

JUDUL PENELITIAN.....	i
ABSTRAK.....	ii
<i>ABSTRACT</i>.....	iii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iv
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
LEMBAR MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	8
C. Pembatasan Masalah.....	8
D. Perumusan Masalah.....	9
E. Kegunaan Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN TEORETIK	
A. Deskripsi Konseptual.....	10
1. Pasar Modal.....	10

2. Efisiensi Pasar.....	11
a. Definisi Efisiensi Pasar.....	11
b. Bentuk-Bentuk Efisiensi Pasar.....	13
3. <i>Abnormal Return</i>	16
a. Definisi <i>Abnormal Return</i>	16
b. Jenis-Jenis <i>Abnormal Return</i>	17
4. Dividen.....	23
a. Pengertian Dividen.....	23
b. Kebijakan Dividen.....	25
c. Jenis-Jenis Dividen.....	26
d. Prosedur Pembagian Dividen.....	28
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	30
C. Kerangka Teoritik.....	31
D. Perumusan Hipotesis.....	33
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Penelitian.....	34
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	34
C. Metode Penelitian.....	34
D. Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel.....	35
E. Teknik Pengumpulan Data.....	37
1. Dividen.....	37
2. <i>Abnormal Return</i>	38
F. Teknik Analisis Data.....	40

1. Uji Normalitas.....	40
2. Uji Homogenitas.....	40
3. Uji Hipotesis.....	41
G. Hipotesis Statistika.....	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Deskripsi Data.....	43
B. Pengujian Hipotesis.....	40
C. Pembahasan.....	50
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	56
B. Implikasi.....	56
C. Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA.....	60
LAMPIRAN.....	62
RIWAYAT HIDUP.....	141

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul	Halaman
1	Tabel Daftar Nama Perusahaan dan Tanggal Pengumuman Dividen.....	62
2	Grafik Poligon AAR Selama <i>Event Period</i>	65
3	Analisis <i>Abnormal Return</i> Tiap Saham Per Periode Peristiwa.....	66
4	Analisis <i>Abnormal Return</i> Tiap Saham.....	114
5	Uji Normalitas <i>Average Abnormal Return</i> (AAR) Sebelum dan Sesudah Periode Peristiwa.....	129
6	Uji Homogenitas.....	130
7	Uji Hipotesis <i>Paired Sample t-test</i>	131
8	Tabel Penentuan Jumlah Sampel	132
9	Tabel Distribusi F	133
10	Z Tabel	134
11	Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	135
12	Contoh Informasi Tanggal Pengumuman Dividen	138

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
II.1	Tabel Hubungan Bentuk Efisiensi Pasar dengan Informasi.....	15
IV.1	Tabel Pemetaan Bulan Pengumuman Dividen.....	43
IV.2	Tabel Analisis Deskriptif Data Tiap Event Period.....	44

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
I.1	Pergerakan IHSG Tahun 2004-2012.....	2
II.1	Bentuk Efisiensi Pasar.....	14
IV.1	Kandungan Informasi Suatu Pengumuman.....	53