

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINILITAS SKRIPSI .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
ABSTRAK .....	vii
ABSTRACT .....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL .....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Manfaat Penelitian .....	8
1.5 Sistematika Penulisan .....	8
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	10
2.1 Landasan Teori.....	10
2.1.1 Pengertian dan Fungsi Pasar Modal .....	10
2.1.2 Efisiensi Pasar Modal .....	11
2.1.3 <i>Value at Risk</i> .....	12
2.1.4 <i>Event Study</i> .....	14
2.1.5 <i>Overreaction Hypothesis</i> .....	15
2.1.6 Pendapatan Saham.....	16
2.1.7 Pengaruh <i>Extreme Market Event</i> terhadap <i>Overreaction</i> .....	19
2.2 Penelitian Terdahulu.....	20
2.3 Hipotesis Penelitian .....	21
2.4 Model Analisis .....	23
2.5 Kerangka Berpikir.....	23

BAB 3 METODE PENELITIAN .....	24
3.1 Pendekatan Penelitian.....	24
3.2 Identifikasi Variabel .....	24
3.3 Definisi Operasional .....	25
3.4 Jenis dan Sumber Data .....	26
3.5 Prosedur Penentuan Sampel.....	27
3.6 Prosedur Pengumpulan Data.....	27
3.7 Teknik Analisis .....	28
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN .....	33
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	33
4.2 Deskripsi Hasil Penelitian .....	33
4.2.1 Extreme Market Event.....	33
4.2.2 Statistik Deskriptif.....	38
4.3 Pengujian Asumsi Klasik .....	41
4.4 Analisis Model dan Pengujian Hipotesis.....	42
4.5 Pembahasan.....	46
4.5.1 Kategori <i>All Event</i> .....	46
4.5.2 Kategori <i>Positive Event</i> dan <i>Negative Event</i> .....	47
4.5.3 Kategori <i>Local Event</i> dan <i>Global Event</i> .....	48
4.5.4 Kategori Subsampel.....	49
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN .....	53
5.1 Simpulan.....	53
5.2 Saran .....	54
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	