

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PEGESAHAN.....	iii
HALAMAN MOTTO.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
UCAPAN TERIMA KASIH.....	vii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I.	
PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah.....	11
C. Batasan Masalah.....	11
D. Tujuan Penelitian.....	12
E. Hipotesis Penelitian.....	12
F. Manfaat Penelitian.....	12
G. Sistematika Penulisan.....	13
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA.....	14
A. Pengertian Saham.....	14
B. Pengertian Pasar Modal.....	15
C. Manfaat Pasar Modal.....	16
D. Perkembangan Pasar Modal Indonesia.....	18
E. Jenis Sekuritas Pasar Modal.....	21
F. Faktor-Faktor Keberhasilan Pasar Modal.....	22
G. Pasar Perdana dan Pasar Sekunder di Bursa - Utama.....	27 30
H. Efisiensi Pasar Modal.....	32
I. Gaya Investasi.....	33
J. Return Saham.....	38
K. Return Market.....	39
L. Penelitian Tredahulu.....	39
BAB III. METODE PENELITIAN.....	41
A. Populasi Penelitian.....	41

B. Data.....	41
C. Metode Analisis Data.....	43
BAB IV. HASIL DAN ANALISIS PENELITIAN....	46
A. Hasil Penelitian.....	46
1. Perkembangan Kinerja Bursa Efek di- Indonesia.....	46
a. Kinerja Bursa Efek Sebelum Kenaikan BBM.....	47
b. Kinerja Bursa Efek Sesudah Kenaikan BBM.....	48
2. Variabel Penelitian.....	49
Mean Abnormal Return Saham.....	50
B. Analisis Hasil Penelitian.....	54
Hasil t-hitung	56
C. Ranking Penelitian.....	60
1. Ranking Sebelum Kenaikan BBM....	61
2. Ranking Sesudah Kenaikan BBM....	62
3. Perubahan Ranking.....	63
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	67
A. Kesimpulan.....	67
B. Saran.....	68
DAFTAR PUSTAKA.....	70

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Perkembangan Saham Di Bursa Efek Jakarta.....	3
Tabel 1.2 Volume Penjualan Mobil.....	7
Tabel 4.1 Kinerja Bursa Efek Jakarta Periode Februari-Juni 2001.....	47
Tabel 4.2 Kinerja Bursa Efek Jakarta Periode Agustus - Oktober 2001.....	48
Tabel 4.3 Mean Abnormal Return Saham Sebelum dan - Sesudah Kenaikan BBM.....	50
Tabel 4.4 Hasil Pengujian Mean Abnormal Return Saham - Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	54
Tabel 4.5 Ranking 13 Perusahaan Yang Termasuk Dalam Industri Otomotif Sebelum Kenaikan BBM.....	61
Tabel 4.6 Ranking 13 Perusahaan Yang Termasuk Dalam Industri Otomotif Sesudah Kenaikan BBM.....	62
Tabel 4.7 Perubahan Mean Abnormal Return Saham Pada 13 Industri Otomotif Sebelum Dan Sesudah - Kenaikan BBM.....	63

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Nama-Nama Perusahaan Yang Termasuk dalam Industri Otomotif.....	73
Lampiran 2 Harga Saham Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	75
Lampiran 3 Return Saham Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	89
Lampiran 4 Return Market Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	103
Lampiran 5 Abnormal Return Saham Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	106
Lampiran 6 Hasil Pengujian Terhadap Abnormal Return Saham Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM...	120