

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	ix
ABSTRAK.....	v
ABSTRACT	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian	10
1.3.1. Tujuan Penelitian	10
1.3.2. Kegunaan Penelitian	10
1.4. Sistematika Penulisan	10
BAB II TELAAH PUSTAKA	12
2.1. Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu	12

2.1.1.	Landasan Teori.....	12
2.1.1.1	<i>Dividend Irrelevance Theory</i>	12
2.1.1.2	<i>Bird in the Hand Theory</i>	14
2.1.1.3	<i>Tax Preference Theory</i>	15
2.1.1.4	<i>Clientele Effect Theory</i>	16
2.1.1.5	<i>Residual Dividend Theory</i>	16
2.1.1.6	<i>Dividend Signalling Theory</i>	17
2.1.2.	<i>Corporate Action</i>	18
2.1.3.	Dividen.....	26
2.1.3.1	Pengertian Dividen.....	26
2.1.3.2	Jenis-jenis Dividen.....	26
2.1.3.3	Kronologi Pembayaran Dividen Tunai	29
2.1.4.	Pasar Modal	30
2.1.4.1	Instrumen Pasar Modal	31
2.1.4.2	Pelaku Pasar Modal.....	34
2.1.4.3	Jenis Pasar Modal	36
2.1.4.4	Pasar Efisien.....	38
2.1.5	Indeks LQ-45	41
2.1.6	Return Saham.....	43
2.1.7	<i>Realized Return</i>	45
2.1.8	<i>Expected Return</i>	46
2.1.8.1	<i>Mean-adjusted Model</i>	47
2.1.8.2	<i>Market Model</i>	47
2.1.8.3	<i>Market-adjusted Model</i>	48
2.1.9	<i>Abnormal Return</i>	49
2.2.	Penelitian Terdahulu	50
2.3.	Kerangka Pemikiran	57
2.4	Hipotesis	58
2.4.1	Hipotesis Pertama	58
2.4.2	Hipotesis Kedua.....	58

BAB III METODE PENELITIAN	59
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	59
3.2. Populasi dan Sampel.....	61
3.3. Jenis dan Sumber Data.....	61
3.4. Metode Pengumpulan Data.....	62
3.5. Metode Analisis Data	62
3.5.1 Metode <i>Event Study</i>	62
3.5.2 Metode Pengamatan.....	67
3.5.3 Pengujian Hipotesis	68
3.5.3.1 Uji <i>Normalitas</i>	68
3.5.3.2 Uji <i>Paired Sample t-test</i>	68
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	69
4.1. Deskripsi Objek Penelitian	69
4.2. Analisis Data.....	70
4.2.1 Return Saham dan Return Pasar	72
4.2.2 <i>Abnormal Return</i>	74
4.2.3 Pengujian Normalitas Data	77
4.2.4 Pengujian Hipotesis	78
4.2.4.1 Pengujian Hipotesis Pertama	79
4.2.4.2 Pengujian Hipotesis Kedua	80
4.3. Interpretasi Hasil.....	81
BAB V PENUTUP	83
5.1. Kesimpulan	83
5.2. Keterbatasan Penelitian.....	84
5.3. Saran.....	84
DAFTAR PUSTAKA	86
LAMPIRAN.....	90