

DAFTAR ISI		i
LEMBAR PENGESAHAN		ii
ABSTRAKSI		iii
ABSTRACT		iv
KATA PENGANTAR		vii
DAFTAR ISI		viii
DAFTAR TABEL		ix
DAFTAR GAMBAR		1
BAB I: PENDAHULUAN		1
1.1 Latar Belakang Penelitian		11
1.2 Identifikasi Masalah dan Rumusan Masalah		11
1.2.1 Identifikasi Masalah		12
1.2.2 Rumusan Masalah		13
1.3 Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian		13
1.3.1 Tujuan Penelitian		13
1.3.2 Kegunaan Penelitian		15
BAB II: LANDASAN TEORI		15
2.1 Kajian Pustaka		15
2.1.1 Pasar Modal		15
2.1.1.1 Pengertian Pasar Modal		16
2.1.1.2 Fungsi dan Manfaat Pasar Modal		18
2.1.1.3 Pasar yang Efisien		19
2.1.1.4 Alasan – alasan Pasar yang Efisien		20
2.1.1.5 Alasan – alasan Pasar yang Tidak Efisien		20
2.1.1.6 Sekuritas Pasar Modal		22
2.1.1.7 <i>Corporate Action</i>		23
2.1.2 <i>Right Issue</i>		23
2.1.2.1 Pengertian <i>Right Issue</i>		26
2.1.2.2 Hal – Hal yang Perlu Diperhatikan Dengan Adanya <i>Right Issue</i>		26
2.1.2.3 Hal – Hal yang Berkaitan Dengan <i>Right Issue</i>		28
2.1.3 Harga Saham		28
2.1.3.1 Pengertian Harga Saham		30
2.1.4 <i>Return</i> Saham dan <i>Abnormal Return</i>		33
2.1.5 Likuiditas Saham		33
2.1.5.1 Pengertian Likuiditas Saham		35
2.2 Dampak <i>Right Issue</i> Terhadap <i>Abnormal Return</i> dan Likuiditas Saham		37
2.3 Penelitian Terdahulu		39
2.4 Kerangka Pemikiran		42
2.5 Paradigma Penelitian		42
2.6 Hipotesis		43

BAB III: OBJEK DAN METODE PENELITIAN	43
3.1 Objek Penelitian	44
3.2 Metode dan Desain Penelitian	44
3.2.1 Metode Penelitian	44
3.2.2 Desain Penelitian	46
3.3 Operasionalisasi Variabel	47
3.4 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	47
3.4.1 Sumber Data	48
3.4.2 Teknik Pengumpulan Data	48
3.5 Populasi	49
3.6 Sampel	49
3.6.1 Teknik Pengambilan Sampel	52
3.7 Rancangan Analisis	53
3.7.1 Rancangan Uji Hipotesis	54
3.7.2 Penentuan Uji Statistik	57
BAB IV: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	57
4.1 Hasil Penelitian	57
4.1.1 Profil Perusahaan	85
4.1.2 Deskripsi Data Variabel yang Diteliti	85
4.1.2.1 Gambaran Daftar Perusahaan yang Melakukan <i>Right Issue</i>	88
4.1.2.2 Gambaran <i>Abnormal Return</i>	94
4.1.2.3 Gambaran Likuiditas Saham	98
4.2 Analisis Statistik Deskriptif	98
4.2.1 Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	99
4.2.2 Statistik Deskriptif Likuiditas Saham	101
4.3 Uji Hipotesis	101
4.3.1 Uji Hipotesis Pertama	102
4.3.2 Uji Hipotesis Kedua	103
4.4 Pembahasan	103
4.4.1 Analisis <i>Right Issue</i> Terhadap <i>Abnormal Return</i>	105
4.4.2 Analisis <i>Right Issue</i> Terhadap Likuiditas Saham	107
BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN	107
5.1 Kesimpulan	108
5.2 Saran	109
DAFTAR PUSTAKA	113
LAMPIRAN – LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Perkembangan Perusahaan yang Melakukan <i>Right Issue</i> di Indonesia	3
Tabel 2.1 Peneliti Terdahulu	38
Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel	46
Tabel 3.2 Daftar Emiten yang Menjadi Sampel	50
Tabel 4.1 Daftar Emiten yang Menjadi Sampel	85
Tabel 4.2 Rata – rata <i>Abnormal Return</i> Perusahaan 10 Hari Sebelum dan 10 Hari Setelah <i>Right Issue</i>	90
Tabel 4.3 Rata – rata <i>Trading Volume Activity</i> Perusahaan 10 Hari Sebelum dan 10 Hari Setelah <i>Right Issue</i>	95
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	98
Tabel 4.5 Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	99
Tabel 4.6 Uji <i>Paired T-Test Abnormal Return</i>	101
Tabel 4.7 Uji <i>Paired T-Test Trading Volume Activity</i>	102

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	41
Gambar 2.2 Paradigma	42
Gambar 3.1 Rumus T-test	55



Binsar Parsaulian, 2014

Analisis Dampak Pengumuman Right Issue yang Diukur Menggunakan Indikator Abnormal Return dan Likuiditas Saham Pada Saat Sebelum dan Sesudah Right Issue Tahun 2010 - 2012 di BEI

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu