

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	iii
ABSTRAK	iv
MOTTO	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I : PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian.....	9
D. Manfaat Penelitian	9
BAB II: TINJAUAN PUSTAKA	
A. Landasan Teori.....	10
A.1. Investasi.....	10
A.2. Pasar Modal	11
A.3. Pasar Perdana	12
A.4. Pasar Sekunder	12
A.5. Saham	13
A.6. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	14
A.7. Indeks LQ45	14
A.8. Efisiensi Pasar	15
A.9. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	17
A.10. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	18

A.11. Teori Asimetris Informasi	19
A.12. Krisis Politik.....	19
A.13. <i>Abnormal Return</i>	20
A.14. <i>Trading Volume Activity</i>	21
B. Penelitian Terdahulu	21
C. Kerangka Pemikiran.....	26
D. Hipotesis Penelitian.....	26

BAB III: METODE PENELITIAN

A. Rancangan Penelitian.....	28
B. Periode Pengamatan	28
C. Populasi	29
D. Sampel dan Teknik <i>Sampling</i>	30
E. Klasifikasi Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	31
E.1. Klasifikasi Variabel Penelitian	31
E.2. Definisi Operasional Variabel	32
F. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	38
F.1. Jenis Data Penelitian	38
F.2. Sumber Data Penelitian.....	38
G. Metode Pengumpulan Data.....	39
H. Teknik Analisis Data.....	39
H.1. Uji Hipotesis.....	40

BAB IV: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Analisis Deskriptif	44
B. Pengujian Hipotesis.....	49
B.1. Pengujian Hipotesis 1 (Analisis <i>One Sample t-Test</i>).....	49
B.2. Pengujian Hipotesis 2 (Analisis <i>Paired Sample t-Test</i>).....	51
B.3. Pengujian Hipotesis 3 (Analisis <i>Paired Sample t-Test</i>).....	52
C. Pembahasan.....	53
C.1. AAR yang Terjadi Sebelum dan Sesudah Pengumuman	53
C.2. Perbedaan AAR Sebelum dengan Sesudah Pengumuman	54

C.3. Perbedaan ATVA Sebelum dengan Sesudah Pengumuman	55
BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan	56
B. Saran.....	56
B.1. Bagi Peneliti Selanjutnya.....	57
B.2. Bagi Investor.....	57
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN - LAMPIRAN	61