

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN .....	ii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iii
ABSTRAK .....	iv
MOTTO.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI .....	ix
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah.....	8
C. Tujuan Penelitian .....	9
D. Manfaat Penelitian .....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	11
A. Landasan Teori .....	11

1. Studi Peristiwa ( <i>Event Study</i> ) .....	11
2. Pasar Modal Efisien .....	14
3. Teori Asimetri Informasi .....	17
4. Teori Sinyal ( <i>Signaling Theory</i> ) .....	19
5. Saham .....	20
6. Harga Saham.....	23
7. <i>Abnormal Return</i> .....	29
8. Aktivitas Volume Perdagangan ( <i>Trading Volume Activity</i> ).....	32
B. Penelitian Terdahulu .....	33
C. Hubungan Antar Variabel .....	35
D. Kerangka Penelitian .....	36
E. Hipotesis Penelitian.....	38
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>39</b>
A. Rancangan Penelitian.....	39
B. Obyek Penelitian.....	40
C. Populasi dan Sampel .....	41
D. Periode Pengamatan.....	42
E. Jenis Data Penelitian .....	43
F. Prosedur Pengambilan Data .....	44
G. Definisi Operasional Variabel .....	45
H. Teknik Analisis Data.....	46

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....	53
A. Hasil Penelitian.....	53
B. Pembahasan .....	59
BAB V PENUTUP .....	72
A. Kesimpulan.....	72
B. Saran.....	73
DAFTAR PUSTAKA .....	75
LAMPIRAN .....	79

## DAFTAR TABEL

<i>1.1 Sport Events: Type and Dimensions</i> .....	3
<i>1.2 Type of Sports Event</i> .....	4
2.1 Penelitian Terdahulu .....	34
3.1 Emiten Sponsor <i>Asian Games</i> 2018.....	41
4.1 Hasil Statistik Deskriptif Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> .....	53
4.2 Hasil Statistik Deskriptif Rata-Rata <i>Trasing Volume Activity</i> .....	55
4.3 Hasil Uji <i>One Sample t-test Abnormal Return</i> .....	56
4.4 Hasil Uji <i>One Sample t-test Trading Volume Activity</i> .....	57
4.5 Hasil Uji <i>Paired Sample t-test Rata-Rata Abnormal Return</i> .....	58
4.6 Hasil Uji <i>Paired Sample t-test Rata-Rata Trading Volume Activity</i> .....	59

## DAFTAR GAMBAR

2.1 Kerangka Penelitian .....	37
3.1 Periode Pengamatan dan Periode Estimasi.....	43

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Perhitungan <i>Expected Return</i> .....	80
Lampiran 2: Harga Penutupan ( <i>Closing Price</i> ) .....	81
Lampiran 3: Perhitungan <i>Actual Return</i> .....	82
Lampiran 4: Perhitungan <i>Abnormal Return</i> .....	83
Lampiran 5: Hasil Perhitungan Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> .....	84
Lampiran 6: Jumlah Saham Beredar .....	85
Lampiran 7: Volume Transaksi .....	86
Lampiran 8: Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i> .....	87
Lampiran 9: Hasil Perhitungan Rata-Rata <i>Trading Volume Activity</i> .....	88
Lampiran 10: Hasil Analisis Statistik Deskriptif.....	89
Lampiran 11: Hasil Pengujian Hipotesis .....	90