

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
LEMBAR PENGESAHAN .....	ii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iii
ABSTRAK .....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	vi
MOTTO .....	vii
KATA PENGANTAR .....	viii
DAFTAR ISI .....	x
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian .....	7
D. Manfaat Penelitian .....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	9
A. Landasan Teori .....	9
1. Pasar Modal Efisien .....	9
a. Definisi Efisiensi Pasar Modal .....	9
b. Bentuk-Bentuk Efisiensi Pasar Modal.....	10
c. Ciri-Ciri Pasar Efisien dan Tidak Efisien.....	11
2. <i>Event Study</i> .....	12
a. <i>Return Saham</i> .....	13
b. <i>Abnormal Return</i> .....	15
c. <i>Trading Volume Activity</i> .....	18
B. Penelitian Terdahulu .....	19
C. Kerangka Pemikiran .....	21
D. Hipotesis Penelitian .....	23
BAB III METODE PENELITIAN .....	24
A. Rancangan Penelitian .....	24
B. Obyek dan Periode Pengamatan .....	24
C. Jenis dan Sumber Data .....	26
D. Prosedur Pengambilan Data.....	27

E. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel .....	27
1. <i>Abnormal Return</i> .....	28
2. <i>Trading Volume Activity</i> .....	30
F. Teknik Analisis Data .....	31
1. <i>One Sample t-Test</i> .....	31
2. <i>Paired Sample t-Test</i> .....	32
 BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....	 35
A. Hasil Penelitian .....	35
1. Statistik Deskriptif .....	35
a. <i>Abnormal Return</i> .....	35
b. <i>Trading Volume Activity</i> .....	39
2. Pengujian Hipotesis .....	42
a. Pengujian Hipotesis 1 .....	42
b. Pengujian Hipotesis 2 .....	44
B. Pembahasan.....	46
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....	 50
A. Kesimpulan .....	50
B. Saran .....	51
 DAFTAR PUSTAKA .....	 52
LAMPIRAN .....	54