

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
MOTTO.....	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	7
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
BAB II.....	9
A. Landasan Teori	9
1. Teori Asimetri.....	9
2. Teori Sinyal (<i>Signaling theory</i>)	9
3. Pasar Modal	10
4. Pasar Modal Efisien.....	11
5. Indeks IDX80.....	12
6. Saham.....	14
7. Harga Saham.....	15
8. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	18
9. <i>Return</i> Sesungguhnya (<i>Actual Return</i>)	19
10. <i>Return</i> Ekspektasian (<i>Expected Return</i>)	20
11. Abnormal Return	22

12. Aktivitas Volume Perdagangan	23
B. Penelitian Terdahulu.....	24
C. Hubungan Antar Variabel.....	25
D. Kerangka Penelitian.....	28
E. Hipotesis Penelitian	28
BAB III.....	30
A. Metode Penelitian	30
B. Objek Penelitian	30
C. Sampel dan Teknik Sampling.....	31
D. Periode Pengamatan	31
E. Jenis Data Penelitian.....	32
F. Teknik Pengambilan Data	32
G. Definisi Operasional Variabel	33
H. Teknik Analisis Data	35
BAB IV	40
A. Hasil Penelitian.....	40
1. Statistik Deskriptif Data.....	40
2. Pengujian Hipotesis	45
B. Pembahasan	48
1. <i>Abnormal Return</i>	48
2. <i>Trading Volume Activity</i>	49
BAB V.....	51
A. Kesimpulan.....	51
B. Saran	51
REFERENCES.....	53
LAMPIRAN.....	56

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	24
Tabel 4.1 Hasil Perhitungan Rata-Rata Abnormal Return.....	40
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif Rata-Rata Abnormal Return.....	41
Tabel 4.3 Hasil Perhitungan Rata-Rata Trading Volume Activity	42
Tabel 4.4 Hasil Statistik Deskriptif Rata-Rata Trading Volume Activity	43
Tabel 4.5 Hasil Uji Paired Samples Test Rata-Rata Abnormal Return	45
Tabel 4.6 Hasil Uji Paired Samples Test Rata-Rata Trading Volume Activity....	47

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	28
Gambar 3.1 Periode Pengamatan	32
Gambar 4.1 Pergerakan Rata-Rata Abnormal Return.....	40
Gambar 4.2 Pergerakan Rata-Rata Trading Volume Activity	43

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Daftar Perusahaan dalam Indeks IDX80.....	57
Lampiran 2: Hasil Perhitungan <i>Return Market</i>	60
Lampiran 3: Hasil Perhitungan <i>Abnormal return</i>	61
Lampiran 4: Hasil Perhitungan Rata-Rata <i>Abnormal Return</i>	88
Lampiran 5: Hasil Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i>	89
Lampiran 6: Hasil Perhitungan Rata-Rata <i>Trading Volume Activity</i>	116
Lampiran 7: Hasil Analisis Statistik Deskriptif.....	117
Lampiran 8: Hasil Pengujian Hipotesis	118