

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
MOTTO.....	vi
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah.....	8
C. Tujuan.....	8
D. Manfaat.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	10
A. Landasan Teori.....	10
1. Investasi.....	10
2. Pasar Modal.....	11
3. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	11
4. Indeks LQ-45.....	12
5. Hipotesis Pasar Efisien (EMH).....	12
6. Teori Sinyal ( <i>Signalling Theory</i> ).....	14
7. Studi Peristiwa.....	15
8. Abnormal Return.....	17
9. Trading <i>Volume Activity</i> .....	20
B. Penelitian Terdahulu.....	20
C. Kerangka Penelitian.....	22
D. Hipotesis Penelitian.....	23
BAB III METODE PENELITIAN.....	25
A. Rancangan Penelitian.....	25
B. Periode Pengamatan.....	25
C. Populasi.....	27
D. Sampel dan Teknik Sampling.....	27

E. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	28
1. Jenis Data Penelitian.....	28
2. Sumber Data Penelitian.....	29
F. Teknik Pengumpulan Data.....	29
G. Pengukuran Variabel Penelitian.....	30
1. <i>Abnormal Return</i> .....	30
2. <i>Trading Volume Activity</i> .....	32
H. Teknik Analisis Data.....	32
1. <i>One-sample-t-test</i> .....	32
2. <i>Paired t-test</i> .....	33
3. Pengujian Hipotesis.....	34
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	38
A. Hasil Penelitian.....	38
1. Analisis Deskriptif.....	38
2. Analisis Kuantitatif.....	42
3. Uji Hipotesis.....	44
B. Pembahasan.....	46
1. <i>Abnormal Return</i> Selama Periode Pengamatan.....	46
2. Perbedaan AAR Sebelum dan Sesudah Peristiwa.....	47
3. Perbedaan TVA Sebelum dan Sesudah Peristiwa.....	48
BAB V.....	49
A. Kesimpulan.....	49
B. Saran.....	49
DAFTAR PUSTAKA.....	51
LAMPIRAN 1.....	54