

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Permasalahan	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	8

BAB II TINJAUAN PUSTAKA	10
A. Landasan Teori.....	10
1. Anomali Pasar	10
2. Pasar Modal.....	11
3. Efisiensi Pasar	12
4. Studi Peristiwa.....	14
5. Return	15
B. Penelitian Terdahulu	20
C. Kerangka Konseptual	21
D. Hipotesis Penelitian.....	24
BAB III METODE PENELITIAN	25
A. Rancangan Penelitian	25
B. Objek dan Waktu Penelitian.....	25
C. Populasi	26
D. Sampel dan Teknik Sampling	27
E. Jenis Data Penelitian	27
F. Prosedur Pengambilan Data	27
G. Definisi Operasional Variabel.....	28

H.	Uji Normalitas	32
I.	Teknik Analisis Data	33
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		38
A.	Hasil Penelitian	38
1.	Statistik Deskriptif Data	38
2.	Uji Normalitas	44
3.	Uji Hipotesis	45
B.	Pembahasan	48
1.	<i>Abnormal return</i> selama periode penelitian. (Hipotesis 1)	48
2.	Perbedaan sebelum dan setelah pemberlakuan PSBB pada <i>abnormal return</i> dan <i>trading volume activity</i> . (Hipotesis 2)	50
BAB V Penutup		53
A.	Kesimpulan	53
B.	Saran	53
DAFTAR PUSTAKA		55
LAMPIRAN		57