

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
PERSEMBAHAN.....	iv
MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
Abstrak.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah.....	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	9
BAB II.....	10
TINJAUAN PUSTAKA	10
A. Landasan Teori.....	10
1. Investasi	10
2. Pasar Modal	11
3. Indeks LQ-45	13
4. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	14
5. Hipotesis Pasar Efisien (EMH).....	15
6. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	17
7. Studi Peristiwa	18
8. <i>Return Tak Normal (Abnormal return)</i>	19
9. <i>Trading Volume Activitiy</i>	23
B. Penelitian Terdahulu	24
C. Kerangka Penelitian	26
D. Hipotesis	27
BAB III	29

METODE PENELITIAN.....	29
1. Jenis Penelitian.....	29
2. Periode Penelitian	30
3. Populasi.....	31
4. Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel.....	31
4. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	33
5. Teknik Pengumpulan Data.....	34
6. Pengukuran Variabel Penelitian.....	35
7. Teknik Analisis Data.....	37
BAB IV	42
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
A. Hasil Penelitian	42
1. Analisis Deskriptif	42
2. Uji Hipotesis	50
B. Pembahasan.....	56
1. Reaksi Pasar Selama Periode Pengamatan.....	56
2. Perbedaan AAR Sebelum dan Sesudah	58
3. Perbedaan TVA Sebelum dan Sesudah.....	59
BAB V	61
A. Kesimpulan	61
B. Saran	62
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN.....	65