

## 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 .....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiii
BAB 1 : PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah .....	6
C. Tujuan Penelitian .....	6
D. Manfaat Penelitian .....	7
BAB II : TINJAUAN PUSTAKA .....	8
A. Landasan Teori.....	8
1. Return Saham.....	8
a. <i>Abnormal Return</i> .....	8
2. <i>Trading Volume Activity</i> ..	11
3. Pasar Modal .....	12

a. Efisiensi Pasar .....	12
b. Anomali Pasar .....	13
c. Teori Sinyal ( <i>Signaling Theory</i> ) .....	16
d. Teori Asimetris Informasi .....	16
e. Indeks Harga Saham .....	18
B. Penelitian Terdahulu.....	19
C. Kerangka Konseptual .....	21
D. Hipotesis Penelitian .....	22
<b>BAB III : METODE PENELITIAN .....</b>	<b>23</b>
A. Rancangan Penelitian .....	23
B. Objek dan Waktu Penelitian.....	23
C. Populasi .....	24
D. Teknik Sampling dan Sampel .....	25
E. Jenis Data Penelitian.....	25
F. Prosedur Pengambilan Data .....	25
G. Klasifikasi Variabel Penelitian.....	26
H. Definisi Operasional Variabel.....	26
I. Teknik Analisis Data .....	28
<b>BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>33</b>
A. Hasil Penelitian .....	33
1. Deskripsi Variabel.....	33
2. Uji Hipotesis .....	41
B. Pembahasan .....	48
<b>BAB V : KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>52</b>
A. Kesimpulan .....	52
B. Saran .....	52
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>54</b>

LAMPIRAN .....	56
----------------	----

