

## DAFTAR ISI

JUDUL.....	i
PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN SKRIPSI.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
ABSTRAKSI .....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
BAB I PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah .....	14
C. Tujuan Penelitian.....	14
D. Manfaat Penelitian.....	15
BAB II Tinjauan Pustaka.....	16
A. Landasan Teori .....	16
1. Pasar Modal .....	16
2. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) .....	16
3. Indeks LQ-45.....	17
4. Studi Peristiwa.....	19
5. Reaksi Pasar .....	19
6. Anomali Pasar .....	21
7. <i>Return Saham</i> .....	24
8. <i>Abnormal Returns</i> .....	29
9. Trading Volume Activity .....	30
BAB III Metode Penelitian .....	39
A. Rancangan Penelitian .....	39
B. Periode Pengamatan .....	39
C. Populasi .....	40

D.	Sampel dan Teknik Sampling.....	41
E.	Jenis Data Penelitian.....	44
F.	Metode Pengumpulan Data .....	45
G.	Definisi Operasional Variabel .....	47
1.	<i>Abnormal Return</i> .....	47
2.	Trading Volume Activity .....	50
H.	Teknik Analisis Data .....	53
1.	One-sample t-test.....	53
2.	Wilcoxon signed ranks test.....	54
3.	Paired t-test.....	55
3.	Pengujian Hipotesis .....	57
BAB IV	Hasil Penelitian dan Pembahasan .....	61
A.	Hasil Penelitian.....	61
1.	Statistik Deskriptif.....	61
2.	Analisis Kuantitatif.....	69
B.	Pembahasan .....	75
1.	Reaksi Pasar Selama Periode Pengamatan .....	75
2.	Perbedaan Average <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Terjadinya Perang Rusia dan Ukraina.....	77
3.	Perbedaan Average Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Terjadinya Perang Rusia dan Ukraina.....	79
BAB V	Kesimpulan dan Saran .....	81
A.	Kesimpulan.....	81
B.	Saran .....	81
DAFTAR PUSTAKA	.....	83
LAMPIRAN	.....	87