

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
MOTTO.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
ABSTRAK.....	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xix
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Permasalahan.....	1
B. Rumusan Masalah.....	3
C. Tujuan Penelitian.....	4
D. Manfaat Penelitian.....	5
BAB II.....	6
TINJAUAN PUSTAKA.....	6

A. Landasan Teori.....	6
1. Investasi dan Pasar Modal.....	6
2. Indeks Harga Saham Gabungan dan Indeks LQ45.....	7
3. Teori Signal (<i>Signaling Theory</i>) dan Kandungan Informasi.....	8
4. Hipotesis Pasar Efisien.....	9
5. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	10
6. <i>Abnormal Return</i>	12
7. <i>Trading Volume Activity</i>	16
8. Keterkaitan Teori dalam Penelitian.....	17
B. Penelitian Terdahulu.....	19
C. Kerangka Konseptual/Pemikiran.....	24
D. Hipotesis Penelitian.....	26
BAB III.....	27
METODE PENELITIAN.....	27
A. Rancangan Penelitian.....	27
B. Objek Penelitian.....	28
C. Waktu Penelitian.....	28
D. Populasi Penelitian.....	30
E. Teknik Sampling dan Sampel.....	31
F. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	33
G. Prosedur Pengambilan Data.....	33
H. Klasifikasi Variabel Penelitian.....	34
I. Definisi Operasional Variabel.....	34

1. <i>Abnormal Return</i>	34
2. <i>Trading Volume Activity</i>	36
J. Teknik Analisis Data.....	37
1. Analisis Deskriptif.....	37
2. Uji Normalitas.....	37
3. Pengujian Hipotesis.....	38
4. Interpretasi Hasil dan Keterkaitan Teori.....	39
BAB IV.....	40
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	40
A. Hasil Penelitian.....	40
1. Analisis Deskriptif.....	40
2. Pengujian Normalitas.....	44
3. Pengujian Hipotesis.....	47
B. Pembahasan.....	52
BAB V.....	59
KESIMPULAN DAN SARAN.....	59
A. Kesimpulan.....	59
B. Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA.....	62
LAMPIRAN.....	64