

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
ABSTRAK	ix
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	10
A. Landasan Teori	10
1. <i>Efficient Market Hypothesis (EMH)</i>	10
2. Anomali pasar.....	11
3. Investasi.....	12
4. <i>Abnormal Return</i>	14
5. <i>Trading Volume Activity</i>	17
6. <i>Event Study</i>	18
B. Penelitian Terdahulu	21
C. Kerangka Berpikir	26
D. Hipotesis Penelitian.....	26
BAB III METODE PENELITIAN	27
A. Rancangan Penelitian	27
B. Jenis Data Penelitian	27

C. Populasi Penelitian	27
D. Obyek dan Waktu Penelitian.....	29
E. Prosedur Pengambilan Data	29
F. Definisi Operasional Variabel	30
G. Teknik Analisis	32
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	35
A. Hasil Penelitian	35
1. Analisis Deskriptif	35
B. Pembahasan.....	41
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	43
A. Kesimpulan	43
B. Saran.....	43
DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN.....	48