

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	v
HALAMAN ABSTRAKSI	vi
HALAMAN KATA PENGANTAR	vii
HALAMAN DAFTAR ISI	ix
HALAMAN DAFTAR TABEL	xi
HALAMAN DAFTAR TABEL	xii
HALAMAN DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I. PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang.....	1
B. Perumusan Masalah	5
C. Tujuan Penelitian... ..	5
D. Manfaat Penelitian.....	6
E. Sistematika Penulisan.....	6
BAB II. LANDASAN TEORI	
A. Pengertian Pasar Modal.....	7
B. Pengertian Saham.....	8
C. Efisiensi Pasar Modal.....	11
D. Event Study (Studi Peristiwa)	14
E. <i>Return</i> dan <i>Abnormal Return</i> saham.....	15
F. Volume Perdagangan Saham.....	17
G. Indeks LQ45.....	17
H. Pengembangan Hipotesis.....	18

BAB III. METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian.....	21
B. Periode Pengamatan.....	21
C. Populasi dan Sampel.....	21
D. Teknik Pengambilan Sampel.....	22
E. Teknik Pengumpulan Data.....	23
F. Teknik Analisis Data.....	24

BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN

A. Sampel dan Data Penelitian..	28
B. Statistik Deskriptif.....	30
C. Pengujian Normalitas Data.....	31
D. Pengujian <i>One Sampel T-Test</i>	34
E. Pengujian <i>Paired Sampel T-Test</i>	38
F. Pembahasan.....	39
G. Implikasi.....	

BAB V. KESIMPULAN , KETERBATASAN, DAN SARAN

A. Kesimpulan	43
B. Keterbatasan dan Saran	43

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Nama-Nama Perusahaan yang Dijadikan Sampel.....	29
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif Data	30
Tabel 4.3	Normalitas <i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i> Setelah Eliminasi dan Transformasi Data	32
Tabel 4.4	Normalitas Data <i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i> Setelah Eliminasi dan Transformasi Data.....	33
Tabel 4.5	<i>One Sampel T-Tes Abnormal Return</i>	34
Tabel 4.6	<i>One Sampel T-Tes TVA</i>	36
Tabel 4.7	<i>Paired Sampel T-Test</i>	38

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1	Pergerakan Abnormal Return Saham Harian	35
Gambar 4.2	Pergerakan TVA Harian.....	37

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1. Statistika deskriptif
- Lampiran 2. Uji normalitas (sebelum dan sesudah transformasi)
- Lampiran 3. *One sample t-test abnormal return*
- Lampiran 4. *One sample t-test TVA*
- Lampiran 5. *Paired sample t-test*
- Lampiran 6. *Data abnormal return*
- Lampiran 7. *Data TVA*