

Penulis menyadari bahwa skripsi ini masih banyak kekurangan dan karena keterbatasan yang dimiliki oleh penulis. Oleh karena itu, saran dan kritik yang membangun sangat diharapkan demi kemajuan penulisan skripsi ini dimasa yang akan datang. Akhir kata, penulis berharap semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi kita semua.

Palembang, 19 April 2012

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA.....	v
ABSTRAKSI.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	5
C. Hipotesis Penelitian.....	5

D. Tujuan Penelitian	6
E. Manfaat Penelitian	6
F. Metode Penelitian	7
1. Jenis Penelitian	7
2. Teknik Pengambilan Sampel	7
3. Jenis Data Penelitian.....	7
4. Teknik Analisis Data	8
G. Sistematika Penulisan	8

BAB II LANDASAN TEORI

A. <i>Good Corporate Governance</i> (GCG)	10
B. <i>Corporate Governance Perception Index</i>	12
C. Kandungan Informasi dan Reaksi Pasar	14
D. <i>Event Studi</i>	15
E. <i>Abnormal Return</i>	17
1. Model Tanpa Sesuaian resiko.....	19
2. Model Sesuaian Resiko.....	21
3. Model Jalan Acak.....	21

F. <i>Trading Volume Activity (TVA)</i>	22
G. Penelitian Terdahulu	23
I. Pengembangan Hipotesis	24

BAB III METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	27
B. Populasi.....	27
C. Teknik Penentuan Sampel.....	27
D. Variabel Penelitian	28
E. Data Penelitian	29
F. Teknik Pengumpulan Data	30
G. Instrumen Penelitian.....	30
F. Teknik Analisis Data.....	31

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

A. Analisis Data Penelitian	33
1. Sampel Penelitian.....	33
2. Analisis Deskriptif.....	35
3. Uji Normalitas Data.....	40

B. Pengujian Hipotesis	41
1. Uji <i>one sampel t-test</i>	42
2. Uji <i>independent t-test</i>	45
C. Pembahasan Hasil	47

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan	51
B. Keterbatasan Penelitian	52
C. Saran	52

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Kelebihan dan Kekurangan Perioda Jendela Pendek.....	17
dan Panjang	
Tabel 2.2 Kategori Return Normal	19
Tabel 4.1 Rincian Sampel Penelitian	33
Tabel 4.2 Daftar nama perusahaan sampel.....	34
Tabel 4.3 Data tanggal pengumuman CGPI.....	35
Tabel 4.4 Rata-rata <i>abnormal return</i> 2009-2011.....	36
Tabel 4.5 Rata-rata Trading volume activity 2009-2011.....	38
Tabel 4.6 Hasil Pengujian Normalitas Variabel.....	40
Tabel 4.7 Hasil Uji <i>one sampel t-test</i> terhadap <i>abnormal return</i>	41
perusahaan sepuluh besar CGPI	
Tabel 4.8 Hasil Uji <i>one sampel t-test</i> terhadap <i>abnormal return</i>	42
perusahaan non sepuluh besar CGPI	
Tabel 4.9 Hasil Uji one sampel t-test terhadap <i>trading volume</i>	43
Activity perusahaan sepuluh besar	

Tabel 4.10 Hasil Uji one sampel t-test terhadap *trading volume*..... 44

Activity perusahaan nonsepuluh besar

Tabel 4.11 Hasil Uji beda *abnormal return*..... 45

Tabel 4.12 Hasil Uji beda *trading volume activity*..... 46

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1 Rata-rata *Abnormal return* 37

Gambar 4.2 Rata-rata *Trading volume activity*..... 39