

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMBUNG.....	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
HALAMAN MOTTO	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK.....	vii
<i>ABSTRACT</i>	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	6
1.4 Pertanyaan Penelitian.....	7
1.5 Tujuan Penelitian	7
1.6 Manfaat Penelitian	7
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	7
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Teori-Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Teori Efisiensi Pasar	9
2.1.3 <i>Return Saham</i>	11
2.1.4 <i>Expected Return</i>	12
2.1.5 <i>Abnormal Return</i>	14

2.1.6	Volume Perdagangan Saham.....	15
2.1.7	Studi Peristiwa.....	15
2.1.8	Penelitian Terdahulu	16
2.2	Kerangka Pemikiran	20
2.3	Hipotesis Penelitian	22
BAB III METODE PENELITIAN		23
3.1	Karakteristik Penelitian.....	23
3.2	Operasionalisasi Variabel.....	25
3.3	Tahapan Pelaksanaan Penelitian.....	26
3.4	Populasi dan Sampel	28
3.5	Pengumpulan Data.....	30
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	31
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		36
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> dan Volume Perdagangan Saham....	36
4.2	Statistik Deskriptif	37
4.2.1	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham LQ45	37
4.2.2	Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham LQ45	40
4.3	Pengujian Hipotesis	42
4.3.1	Uji Normalitas	43
4.3.2	Uji Wilcoxon	45
4.4	Pembahasan Hasil Penelitian.....	48
4.4.1	<i>Abnormal Return</i> pada Peristiwa	48
4.4.2	Volume Perdagangan Saham pada Peristiwa	48
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		50
5.1	Kesimpulan.....	50
5.2	Saran	50

5.2.1	Bagi Investor	50
5.2.2	Bagi penelitian selanjutnya	50
	LAMPIRAN	54