

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Masalah	3
1.3 Rumusan Masalah	11
1.4 Tujuan Penelitian.....	11
1.5 Manfaat Penelitian.....	12
1.6 Sistematika Penulisan.....	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	15
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu.....	15
2.1.1 <i>Efficient Market Hypothesis (EMH)</i>.....	15
2.1.2 <i>Event</i> dan Reaksi Pasar	17
2.1.3 <i>Return</i>	20
2.1.4 <i>Trading Volume Activity (TVA)</i>.....	23
2.1.5 Penelitian Terdahulu	24
2.2 Kerangka Pemikiran	34
2.3 Hipotesis.....	35
BAB III METODE PENELITIAN	38
3.1 Jenis Penelitian.....	38
3.2 Operasional Variabel.....	39
3.3 Tahapan Penelitian	42

3.4	Populasi dan Sampel.....	45
3.4.1	Populasi.....	45
3.4.2	Sampel.....	45
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data	47
3.6	Teknik Analisis Data.....	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		50
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Trading Volume Activity</i>	50
4.1.1	<i>Abnormal Return</i>	50
4.1.2	<i>Trading Volume Activity</i>	52
4.2	Statistik Deskriptif	52
4.2.1	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> pada Saham LQ45	53
4.2.2	Statistik Deskriptif TVA pada Saham LQ45.....	57
4.3	Uji Hipotesis	62
4.3.1	Uji Normalitas	62
4.3.2	Uji Beda.....	65
4.4	Pembahasan Hasil Penelitian	68
4.4.1	<i>Abnormal Return</i> pada Saham LQ45 di Sekitar Peristiwa Konflik Rusia-Ukraina 68	
4.4.2	<i>Trading Volume Activity</i> pada Saham LQ45 di Sekitar Peristiwa	70
BAB V		74
KESIMPULAN DAN SARAN		74
5.1	Kesimpulan.....	74
5.2	Saran	74
5.2.1	Aspek Teoritis.....	74
5.2.2	Aspek Praktis	75
LAMPIRAN.....		79
DAFTAR PUSTAKA.....		130