

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah.....	9
1.4 Tujuan Penelitian.....	9
1.5 Manfaat Penelitian.....	9
1.5.1 Aspek Teoritis	9
1.5.2 Aspek Praktis	10
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Teori-Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu.....	12
2.1.1 Investasi.....	12
2.1.2 Pasar Modal.....	12
2.1.3 Efisiensi Pasar Modal.....	13
2.1.4 <i>Return</i>	14
2.1.5 <i>Abnormal Return</i>	15
2.1.6 <i>Trading Volume Activity</i>	17
2.1.7 Penelitian Terdahulu	17
2.2 Kerangka Penelitian	21
2.3 Hipotesis Penelitian	22
BAB III METODE PENELITIAN	23

3.1	Jenis Penelitian	23
3.2	Operasional Variabel	24
3.3	Tahapan Penelitian	25
3.4	Populasi dan Sampel	28
3.4.1	Populasi	28
3.4.2	Sampel	28
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data	31
3.5.1	Pengumpulan Data	31
3.5.2	Sumber Data	31
3.6	Teknik Analisis Data	31
3.6.1	Analisis Statistik Deskriptif	32
3.6.2	Uji Asumsi Klasik	32
3.6.3	Uji Hipotesis	32
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		35
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Trading Volume Activity</i>	35
4.1.1	<i>Abnormal Return</i>	35
4.1.2	<i>Trading Volume Activity</i>	36
4.2	Statistik Deskriptif	36
4.2.1	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	36
4.2.2	Statistik deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	38
4.3	Pengujian Hipotesis	40
4.3.1	Uji Normalitas	40
4.3.2	Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	41
4.4	Pembahasan Hasil Penelitian	43
4.4.1	<i>Abnormal Return</i>	44
4.4.2	<i>Trading Volume Activity</i>	44
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		46
5.1	Kesimpulan	46
5.2	Saran	46
5.2.1	Aspek Teoritis	46
5.2.2	Aspek Praktis	47

DAFTAR PUSTAKA	48
LAMPIRAN.....	51