

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
<i>ABSTRACT</i>	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GRAFIK	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I	15
PENDAHULUAN	15
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	15
1.2 Latar Belakang Penelitian	18
1.3 Perumusan Masalah	22
1.4 Tujuan Penelitian	23
1.5 Manfaat Penelitian	24
1.5.1 Aspek Teoritis	24
1.5.2 Aspek Praktis	24
1.6 Sistematika Penelitian Tugas Akhir	24
BAB II	26
TINJAUAN PUSTAKA	26
2.1 Teori-Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu	26
2.1.1 Efisiensi Pasar Modal	26
2.1.2 Return	27
2.1.3 Abnormal return	27
2.1.4 Trading volume activity	30
2.1.5 Penelitian Terdahulu	31
2.2 Kerangka Penelitian	46
2.3 Hipotesis Penelitian	47
BAB III	49
METODE PENELITIAN	49
3.1 Penelitian Terdahulu	49
3.2 Operasional Variabel	50

3.3	Tahapan Penelitian.....	53
3.4	Populasi dan Sampel.....	57
3.4.1	Populasi.....	57
3.4.2	Sampel.....	57
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	59
3.5.1	Pengumpulan Data.....	59
3.5.2	Sumber Data.....	60
3.6	Teknik Analisis Data.....	60
3.6.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	60
3.6.2	Uji Asumsi Klasik.....	61
3.6.3	Uji Hipotesis	61
BAB IV		64
HASIL DAN PEMBAHASAN		64
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal return</i> dan <i>Trading volume activity</i>	64
4.1.1	Abnormal return	64
4.1.2	Trading volume activity.....	69
4.2	Statistik Deskriptif	71
4.3	Pengujian Hipotesis.....	73
4.3.1	Uji Normalitas	74
4.3.2	Uji Paired T-test	75
4.3.2.1	Pengujian Hipotesis 1 (<i>Cumulative Average Abnormal Return</i>) 75	
4.3.2.2	Pengujian Hipotesis 2 (<i>Cumulative Average Trading Volume Activity</i>) 76	
4.4	Pembahasan Hasil Penelitian.....	77
4.4.1	Abnormal Return.....	77
4.4.2	Trading Volume Activity.....	77
BAB V		79
KESIMPULAN DAN SARAN		79
5.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal return</i> dan <i>Trading volume activity</i>	79
5.2	Saran	80
5.2.1	Aspek Teoritis	80
5.2.2	Aspek Praktis	80
DAFTAR PUSTAKA		82
LAMPIRAN.....		85