

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	1
1.3 Perumusan Masalah.....	11
1.4 Tujuan Penelitian	12
1.5 Manfaat Penelitian	12
1.5.1 Aspek Teoritis	12
1.5.2 Aspek Praktis	13
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	15
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu	15
2.1.1 Teori Sinyal.....	15
2.1.2 Investasi	15
2.1.3 Efisiensi Pasar Hipotesis	17
2.1.4 <i>Federal Reserve (Fed Rate)</i>	19
2.1.5 <i>Return Saham</i>	20
2.1.6 <i>Event Study</i>	22
2.1.7 <i>Trading Volume Activity</i>	24
2.1.8 Penelitian Terdahulu	25
2.2 Kerangka Pemikiran.....	49
2.3 Hipotesis Penelitian	50
BAB III METODE PENELITIAN	51

3.1 Jenis Penelitian	51
3.2 Operasionalisasi Variabel.....	52
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	59
3.6 Teknik Analisis	60
3.6.1 Analisis Statistik Deskriptif	60
3.6.2 Uji Normalitas Data	60
3.6.3 Pengujian Hipotesis.....	61
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	65
4.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	65
4.1.1 Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	65
4.1.2 Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	67
4.2 Hasil Penelitian	69
4.2.1 Pengujian Normalitas Data	70
4.2.2 Pengujian Hipotesis.....	71
4.3 Pembahasan Hasil	75
4.3.1 <i>Abnormal Return</i>	75
4.3.2 <i>Trading Volume Activity</i>	76
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	79
5.1 Kesimpulan	79
5.2 Saran.....	79
5.2.1 Saran Teoritis	79
5.2.1 Saran Praktis	80
DAFTAR PUSTAKA	83
LAMPIRAN.....	91