

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL DEPAN .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN JUDUL BELAKANG .....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSETUJUAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN.....</b>	<b>v</b>
<b>RIWAYAT HIDUP.....</b>	<b>vi</b>
<b>PERSEMBAHAN .....</b>	<b>vii</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>viii</b>
<b>ABSTRAK.....</b>	<b>ix</b>
<b>KATA PENGHANTAR.....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR ISI .....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN.....</b>	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	5
1.3 Ruang Lingkup Penelitian .....	6
1.3.1 Subjek .....	6
1.3.2 Objek.....	6
1.3.3 Tempat Penelitian .....	6
1.3.4 Waktu Penelitian.....	6
1.3.5 Ilmu Penelitian.....	6
1.4 Tujuan Penelitian .....	6
1.5 Manfaat Penelitian .....	7
1.6 Sistematika Penulisan .....	7
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b>	
2.1 Teori Efisiensi Pasar .....	9

2.2 Studi Peristiwa (Event Study).....	11
2.3 Pasar Modal .....	11
2.4 <i>information content</i> .....	12
2.5 Abnormal Return .....	13
2.6 Trading Volume Activiy .....	14
2.7 Penelitian Terdahulu .....	15
2.8 Kerangka Pemikiran.....	18
2.9 Hipotesis .....	18
2.10 Pengembangan Hipotesis .....	18
2.10.1Hipotesis Abnormal Return .....	18
2.10.1Hipotesis Trading Volume Activity.....	19

**BAB III METODE PENELITIAN**

3.1 Jenis Penelitian .....	21
3.2 Sumber Data....	21
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	21
3.4 Populasi dan Sampel .....	22
3.4.1 Populasi Penelitian.....	22
3.4.2 Sampel Penelitian.. .....	22
3.5 Teknik Analisis Data .....	24
3.5.1 menghitung AR.....	24
3.5.2 menghitung TVA .....	27
3.5.3 Windows periode .....	27
3.6 Uji Anallisis Data.....	27
3.6.1 Uji Statistik Deskriptif .....	27
3.6.2 Uji Normalitas.....	28
3.7 Pengujian Hipotesis .....	28
3.7.1 Uji <i>Paired Sample T Test</i> .....	28
3.7.2 Uji <i>Wilcoxon Signed-rank test</i> .....	29

**BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

4.1 Deskripsi Objek Penelitian .....	31
4.2 Hasil Analisis Data .....	37

4.3 Hasil Uji Persyaratan Analisis Data.....	43
4.3.1 Hasil Statistika Deskriptif.....	43
4.3.2 Hasil UjiNormalitas .....	44
4.4 Hasil Uji Hipotesis.....	46
4.4.1 Hasil Uji Nonparametrik <i>Wilcoxon signed rank test</i> .....	45
4.5 Pembahasan .....	49

## **BAB V SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan.....	52
5.2 Saran .....	52

## DAFTAR PUSTAKA

## LAMPIRAN