

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.4. Tujuan Penelitian	10
1.5. Manfaat Penelitian	11
1.6. Lingkup Penelitian	12
1.7. Sistematika Penulisan	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1. Landasan Teori	14
2.1.1. Hipotesis Pasar Efisien	14
2.1.2. <i>Return</i> Realisasian dan <i>Return</i> Ekspektasian	17
2.1.3. Studi Peristiwa	19
2.1.4. Risiko Operasional Bank	21
2.1.5. Model Pengukuran Risiko Operasional Bank	25
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	30
2.3. Pengembangan Hipotesis	35
BAB III METODE PENELITIAN	38
3.1. Desain Penelitian	38
3.2. Metode Pengumpulan Data	38
3.3. Instrumen Penelitian	56
3.1.1. <i>Abnormal Return</i>	58
3.1.2. <i>Trading Volume Activity</i>	58
3.4. Metode Analisis Data	58

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	64
4.1. Deskripsi Sampel Penelitian	64
4.2.1. Statistika Deskriptif Data <i>Abnormal Return (AR)</i> dan <i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	66
4.2.2. Statistik Deskriptif <i>Cumulative Abnormal Average Return Saham</i>	71
4.2.3. Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham.....	73
4.3. Hasil Uji Hipotesis Satu.....	78
4.4. Hasil Uji Hipotesis Dua	105
4.5. Hasil Uji Hipotesis Tiga	108
4.6. Pembahasan Hasil Uji Hipotesis.....	112
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	118
5.1. Kesimpulan.....	118
5.2. Implikasi	119
5.3. Keterbatasan.....	120
5.4. Saran	121
DAFTAR PUSTAKA	122

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Kategori Sampel Risiko Operasional Internal dan Eksternal.....	64
Tabel 4.2. Statistik Deskriptif Abnormal Return Saham Kejadian Internal	66
Tabel 4.3. Statistik Deskriptif Abnormal Return Saham Kejadian Eksternal.....	67
Tabel 4.4. Data Cumulative Average Abnormal Return Kejadian Internal vs Kejadian Eksternal	72
Tabel 4.5. Statistik Deskriptif Trading Volume Activity Saham Kejadian Internal	74
Tabel 4.6. Statistik Dekskriptif Trading Volume Activity Saham Kejadian Eksternal.....	75
Tabel 4.7. Hasil Uji Signifikansi Abnormal Return Internal	79
Tabel 4.8. Hasil Uji Signifikansi Abnormal Return Eksternal	80
Tabel 4.9. Hasil Uji Independen T Abnormal Return Saham Kejadian Internal terhadap Kejadian Eksternal	81
Tabel 4.10. Klasifikasi Penilaian Risiko Operasional berdasarkan Frekuensi dan Dampak Risiko Operasional	83
Tabel 4.11. Hasil Klasifikasi Risiko Operasional Internal Berdampak Besar	86
Tabel 4.12. Hasil Klasifikasi Risiko Operasional Eksternal Berdampak Besar ...	90
Tabel 4.13. Hasil Klasifikasi Risiko Operasional Internal Berdampak Kecil.....	93
Tabel 4.14. Hasil Klasifikasi Risiko Operasional Eksternal Berdampak Kecil	99
Tabel 4.15. Hasil Uji T Abnormal Return Kejadian Internal vs Kejadian Eksternal Berdampak Besar	104
Tabel 4.16. Hasil Uji Independen T Cumulative Average Abnormal Return Saham Kejadian Internal terhadap Kejadian Eksternal.....	107
Tabel 4.17. Hasil Uji Signifikansi Trading Volume Activity Internal dan Eksternal	109
Tabel 4.18. Hasil Uji Independen T Trading Volume Activity Saham Kejadian Internal terhadap Kejadian Eksternal	110
Tabel 4.19. Ringkasan Hasil Uji Hipotesis	113

DAFTAR GAMBAR

Gambar 4.1. Grafik AAR Kejadian Risiko Operasional Internal	68
Gambar 4.2. Grafik AAR Kejadian Risiko Operasional Eksternal.....	69
Gambar 4.3. Grafik Perbandingan AAR Kejadian Risiko Operasional Internal vs. Eksternal.....	69
Gambar 4.4. Grafik CAAR Kejadian Risiko Operasional Internal.....	71
Gambar 4.5. Grafik CAAR Kejadian Risiko Operasional Eksternal	71
Gambar 4.6. Grafik TVA Kejadian Risiko Operasional Internal.....	76
Gambar 4.7. Grafik TVA Kejadian Risiko Operasional Eksternal	76
Gambar 4.8. Grafik Perbandingan TVA Kejadian Risiko Operasional Internal vs. Eksternal.....	77

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Hasil Uji Independen T Abnormal Return Kejadian Risiko Operasional Internal dan Eksternal	xii
Lampiran 2. Hasil Uji Independen T Trading Volume Activity Kejadian Risiko Operasional Internal dan Eksternal	xiv
Lampiran 3. Hasil Uji Independen T CAAR Kejadian Risiko Operasional Internal vs Eksternal	xvi
Lampiran 4. Hasil Uji Independen T Abnormal Return Kejadian Risiko Operasional Internal vs Eksternal (Mean Comparison)	xiv
Lampiran 5. Hasil Uji Independen T Trading Volume Activity Kejadian Risiko Operasional Internal vs Eksternal	xx