

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR KEASLIAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI	xi
ABSTRACT.....	xii
PENDAHULUAN	1
1.1 LATAR BELAKANG	1
1.2 RUMUSAN MASALAH.....	4
1.3 TUJUAN PENELITIAN.....	5
1.4 BATASAN MASALAH.....	5
1.5 MANFAAT PENELITIAN	6
1.6 SISTEMATIKA PENELITIAN	7
LANDASAN TEORI.....	8
2.1 PASAR MODAL	8
2.2 STUDI PERISTIWA.....	8
2.3 EFISIENSI PASAR	9
2.4 PSIKOLOGI PASAR DAN PERILAKU INVESTOR.....	10
2.5 <i>RETURN</i> SAHAM.....	11
2.6 <i>ABNORMAL RETURN</i>	11
2.7 <i>EXPECTED RETURN</i>	12
2.8 MEAN ADJUSTED MODEL	13
2.8.1 <i>Market Model</i>	13
2.8.2 <i>Market Adjusted Model</i>	14
2.8.3 <i>Market Return</i>	14
2.9 VOLUME TRADING ACTIVITY	15
2.10 <i>AVERAGE VOLUME TRADING ACTIVITY</i>	15
2.11 PENELITIAN TERDAHULU	15
2.12 PENGEMBANGAN HIPOTESIS	18

METODOLOGI PENELITIAN	23
3.1 DESAIN PENELITIAN	23
3.2 JENIS PENELITIAN DAN SUMBER DATA	24
3.3 POPULASI DAN SAMPEL	24
3.4 PERIODE PENGAMATAN	25
3.5 METODE ANALISIS	27
3.6 METODE PENGUJIAN HIPOTESIS	28
3.6.1 Pengujian Hipotesis I	28
3.6.2 Pengujian Hipotesis II	29
3.6.3 Pengujian Hipotesis III	29
3.6.4 Pengujian Hipotesis IV	30
PEMBAHASAN	31
4.1 Deskripsi Data	31
4.2 Uji Hipotesis	40
4.2.1 Uji Hipotesis Ia	40
4.2.2 Uji Hipotesis Ib	47
4.2.3 Uji Hipotesis IIa	56
4.2.4 Uji Hipotesis IIb	57
4.2.5 Uji Hipotesis IIIa	58
4.2.6 Uji Hipotesis IIIb	59
4.2.7 Uji Hipotesis IVa	60
4.2.8 Uji Hipotesis IVb	62
4.3 Pembahasan	63
KESIMPULAN DAN SARAN	77
5.1 Simpulan	77
5.2 Keterbatasan	78
5.3 Implikasi	79
DAFTAR PUSTAKA	80
LAMPIRAN	84