

DAFTAR ISI

Contents

HALAMAN PERNYATAAN	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Pertanyaan Penelitian	8
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Lingkup Penelitian	9
1.7. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASARN TEORI	12
2.1. Landasan Teori	12
2.1.1. Pasar Modal	12
2.1.2. Penawaran Umum	12
2.1.3. Penawaran Umum Perdana Saham	12
2.1.4. Sistem e-IPO	13
2.1.5. Proses <i>Book Building</i>	13
2.1.6. <i>Underpricing</i>	14
2.1.7. <i>Asymmetric Information</i>	14
2.1.8. Volume saham yang ditawarkan	15
2.1.9. <i>Abnormal Return</i>	16
2.1.10. Volume Transaksi Saham	16
2.1.11. Volatilitas harga saham	17
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	18



2.3.	Perumusan Hipotesis	20
2.4.	Model Penelitian	20
BAB III METODE PENELITIAN		21
3.1.	Desain Penelitian	21
3.2.	Metode Pengumpulan Data	21
3.2.1.	Sumber Data	21
3.2.2.	Metode Pemilihan Sampel	22
3.3.	Variabel Penelitian	22
3.4.	Metode Analisis Data	24
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		26
4.1.	Deskripsi Data	26
4.1.1.	Sampel Penelitian	26
4.1.2.	Deskripsi variable penelitian	26
4.1.2.1.	Volume Saham	26
4.1.2.2.	<i>Abnormal Return</i>	27
4.1.2.3.	Volume Transaksi Saham	28
4.1.2.4.	Volatilitas Harga Saham	28
4.2.	Uji Normalitas	29
4.3.	Pengujian Statistik Non Parametrik Menggunakan Mann-Whitney U	31
4.3.1.	Uji Beda Volume Saham	31
4.3.2.	Uji Beda <i>Abnormal Return</i>	32
4.3.3.	Uji Beda Volume Transaksi Saham	33
4.3.4.	Uji Beda Volatilitas Harga Saham	35
4.4.	Diskusi dan Pembahasan	37
BAB V KESIMPULAN		40
5.1.	Simpulan	40
5.2.	Implikasi	40
5.3.	Keterbatasan	40
5.4.	Saran	41
DAFTAR PUSTAKA		43
LAMPIRAN		44