

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
ABSTRAK	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	12
1.3 Pertanyaan Penelitian	12
1.4 Tujuan Penelitian.....	12
1.5 Manfaat penelitian	13
1.6 Lingkup Penelitian.....	13
1.7 Sistematika Penulisan	14
BAB II LANDASAN TEORI.....	16
2.1 <i>Landasan Teori</i>	16

2.1.1. <i>Market Microstructure</i>	16
2.1.2. Investasi.....	19
2.1.3. Pasar Modal.....	23
2.1.4. Pasar Efisien.....	24
2.1.5. Behavioral Finance.....	27
2.1.6. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	28
2.1.7. Abnormal Volume.....	30
2.1.8. <i>Trading Volume Activity (TVA)</i>	31
2.2 Penelitian Terdahulu.....	32
2.3 Kerangka Penelitian.....	36
2.4 Hipotesis Penelitian	37
BAB III METODE PENELITIAN	40
3.1 Jenis dan Desain Penelitian	40
3.2 Populasi dan Sampel.....	40
3.2.1. Populasi	40
3.2.2. Sampel	42
3.3 Variabel Penelitian	43
3.4 Teknik Pengolahan Data dan Analisis Data	43
3.4.1. Analisis Statistik Deskriptif	45
3.4.2. Uji Normalitas	45
3.5 Pengujian Hipotesis	46
3.5.1. Uji Paired Sample T-Test.....	46
3.5.2. <i>Uji Wilcoxon Signed Rank Test</i>	46

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	47
4.1 Hasil Analisis Deskriptif	47
4.1.1. Volume Perdagangan Saham	47
4.1.2. Keputusan Investor.....	47
4.2 Hasil Analisis Data	48
4.2.1. Hasil Analisis Data Volume Perdagangan Saham	48
4.2.2. Hasil Analisis Data Keputusan Investor	50
4.3 Pembahasan	52
4.3.1. Volume Perdagangan Saham	53
4.3.2. Keputusan Investor.....	58
BAB V KESIMPULAN DAN KETERBATASAN	62
5.1 Kesimpulan.....	62
5.2 Implikasi Penelitian	63
5.2.1. Implikasi Akademis	63
5.2.2. Implikasi Praktis.....	64
5.3 Keterbatasan Penelitian	65
5.4 Saran	66
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	71