

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Sistematika Penulisan	6
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Landasan Teori.....	8
2.1.1 <i>Event Study</i>	8
2.1.2 <i>Normal dan Abnormal Return</i>	8
2.1.3 Volume Perdagangan Saham	9
2.1.4 Indeks LQ 45.....	10

2.1.5	Pasar Modal Efisien	11
2.2	Kajian Penelitian Terdahulu	12
2.3	Kerangka Konsep.....	15
2.4	Perumusan Hipotesis.....	16
2.5	Model Hipotesis	17
BAB 3	METODE PENELITIAN.....	18
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	18
3.2	Definisi Operasional Variabel.....	18
3.3	Populasi dan Sampel	20
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	22
3.5	Metode Analisis	23
3.5.1	Analisis Umum.....	23
3.5.2	Analisis Hipotesis Satu.....	24
3.5.3	Analisis Hipotesis Dua	27
BAB 4	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	29
4.1	Statistik Deskriptif	29
4.2	Uji Normalitas.....	30
4.3	Uji Hipotesis Satu	31
4.4	Uji Hipotesis Dua.....	33
4.5	Pembahasan Hipotesis Satu	35
4.6	Pembahasan Hipotesis Dua.....	38
BAB 5	KESIMPULAN DAN SARAN.....	40
5.1	Kesimpulan	40
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	40



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**ANALISIS PENGARUH KONDISI POLITIK LUAR NEGERI TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN
TRADING VOLUME ACTIVITY
INDEKS LQ 45 (STUDI KASUS PERGANTIAN KEPEMIMPINAN DI AMERIKA SERIKAT TAHUN 2016)**

ENDAH RINI MAYASARI, Mamduh M. Hanafi, Dr., M.B.A.,

Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

5.3 Saran 41

DAFTAR PUSTAKA 42

DAFTAR TABEL

Tabel 3.3.1 Daftar Nama Perusahaan yang Menjadi Sampel Penelitian.....	20
Tabel 4.1.1 Statistik Deskriptif	29
Tabel 4.2.1 Uji Normalitas AR	30
Tabel 4.2.2 Uji Normalitas ATVA.....	30
Tabel 4.3.1 Hasil Uji <i>One Sample T-Test</i> Variabel <i>Cumulative Average Abnormal Return</i> Harian Selama Periode Pengamatan	32
Tabel 4.4.1 Hasil Uji <i>One Sample T-Test</i> Variabel <i>Abnormal Trading Volume Activity</i> Harian Selama Periode Pengamatan	34

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1.1 Pergerakan Indeks LQ 45 Selama Periode Pengamatan	3
Gambar 2.3.1 Kerangka Konsep	16
Gambar 2.5.1 Model Hipotesis	17
Gambar 3.4.1 Periode Pengamatan	23
Gambar 4.3.1 Pergerakan <i>Cumulative Average Abnormal Return</i> Harian selama Periode Jendela.....	31
Gambar 4.4.1 Pergerakan Rata-rata <i>Abnormal Ttrading Volume Activity</i> Harian selama Periode Jendela	33

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: <i>Abnormal Return</i> Harian Perusahaan LQ 45 selama periode pengamatan	45
Lampiran 2: <i>Abnormal Trading Volume Activity</i> Harian Perusahaan LQ 45 selama periode pengamatan	46