

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERSETUJUAN.....	iii
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
ABSTRAK	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Motivasi Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Kontribusi Penelitian	9
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	9
1.9 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Landasan Teori.....	12
2.1.1 Pengertian Pasar Keuangan.....	12
2.1.2 Pendekatan Penilaian Saham.....	13
2.1.3 Laporan Keuangan	14
2.1.4 Pengumuman Laba	15
2.1.5 Volume Transaksi Perdagangan.....	16
2.1.6 Earning Surprise	16

2.1.7	Earning per Share	18
2.1.8	Abnormal Return	18
2.2	Tinjauan Pustaka dan Hipotesis	19
2.2.1	Tinjauan Pustaka	19
2.2.2	Hipotesis	24
2.3	Kerangka Berpikir Konseptual	26
BAB III METODE PENELITIAN		27
3.1	Desain Penelitian	27
3.2	Definisi Operasional Variabel	28
3.2.1	Variabel Penelitian	28
3.2.2	Definisi Operasional	36
3.3	Populasi dan Sampel	37
3.4	Instrumen Penelitian	38
3.5	Teknik Pengumpulan Data	39
3.6	Teknik Analisis Data	40
3.6.1	Uji Normalitas	40
3.6.2	Uji Linearitas	41
3.6.3	Uji Heteroskedastisitas	41
3.6.4	Uji Autokorelasi	42
3.6.5	Uji Multikolinearitas	43
3.6.6	Chow-Test	43
3.6.7	Hausman Test	44
3.6.8	Uji Hipotesis	45
BAB IV PEMBAHASAN		48
4.1	Deskripsi Sampel	48
4.2	Statistik Deskriptif	49
4.3	Uji Asumsi Klasik	52
4.3.1	Uji Normalitas	52
4.3.2	Uji Linearitas	54
4.3.3	Uji Heteroskedastisitas	55
4.3.4	Uji Autokorelasi	56

4.3.5	Uji Multikolinearitas	56
4.4	Pemilihan Model Terbaik	57
4.4.1	Chow Test	58
4.4.2	Hausman Test	58
4.5	Pengujian Hipotesis	59
4.5.1	Pengujian Hipotesis 1	60
4.5.2	Pengujian Hipotesis 2	62
4.6	Pembahasan	64
BAB V SIMPULAN		68
5.1	Simpulan	68
5.2	Keterbatasan	69
5.3	Implikasi	69
5.3.1	Implikasi Teoritis	69
5.3.2	Implikasi Praktis	70
Daftar Pustaka		71
LAMPIRAN		73