

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	9
2.1 Tinjauan Pustaka	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Pasar Efisien.....	10
2.1.3 Suspensi Saham.....	13

2.1.4	<i>Event Study</i>	16
2.1.4.1	<i>Event study</i> konvensional	17
2.1.4.2	<i>Event study cluster</i>	17
2.1.4.3	<i>Event study</i> tak terduga	18
2.1.4.4	<i>Event study</i> berurutan.....	18
2.2	Penelitian Terdahulu	19
BAB III METODE PENELITIAN.....		29
3.1	Desain Penelitian.....	29
3.2	Data dan Sampel Penelitian	30
3.3	Defenisi Variabel Operasional	30
3.3.1	<i>Trading Volume</i>	30
3.3.2	<i>Abnormal Trading Volume</i>	31
3.3.3	Volatilitas Saham	31
3.3.4	<i>Return Saham</i>	31
3.3.5	<i>Expected Return Saham</i>	32
3.3.6	<i>Abnormal Return Saham</i>	32
3.3.7	Durasi Suspensi Saham.....	33
3.4	Teknik Analisis Data.....	33
3.5	Pengujian Hipotesis.....	34
3.5.1	Pengujian Hipotesis 1.....	34
3.5.1.1	Hipotesis 1a.....	34
3.5.1.2	Hipotesis 1b.....	35

3.5.1.3 Hipotesis 1c.....	36
3.5.2 Pengujian Hipotesis 2.....	37
3.5.2.1 Hipotesis 2a.....	37
3.5.2.2 Hipotesis 2b.....	37
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Deskripsi Data.....	39
4.2 Analisis Data	40
4.2.1 Pengujian Hipotesis 1.....	40
4.2.2 Pengujian Hipotesis 2.....	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	50
5.1 Kesimpulan	50
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	51
5.3 Saran.....	52
5.4 Implikasi Penelitian.....	53
DAFTAR PUSTAKA	54
LAMPIRAN.....	56