

## DAFTAR ISI

	Halaman
<b>PERNYATAAN</b> .....	i
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	ii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	iv
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	vi
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	vii
<b>INTISARI</b> .....	viii
<b>ABSTRACT</b> .....	ix
 <b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Manfaat Penelitian .....	8
1.5 Penelitian Terdahulu .....	8
1.6 Sistematika Penulisan.....	10
 <b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b>	
2.1 Pasar Modal .....	11
2.2 Pasar Efisien .....	12
2.3 Event Study.....	16
2.3.1 Abnormal Return .....	17
2.3.2 Single Indeks Model .....	18
2.3.3 Trading Volume Activity.....	19
2.4 Hipotesis .....	20
2.5 Metode Penelitian .....	21

### **BAB III METODE PENELITIAN**

3.1	Jenis Penelitian .....	22
3.2	Pasar Modal Yang Diteliti .....	22
3.3	Pemilihan Sampel .....	22
3.4	Sumber Data .....	24
3.5	Periode Pengamatan.....	24
3.6	Metode Analisis .....	25
3.6.1	Pengujian Hipotesis I dan II.....	26
3.6.2	Pengujian Hipotesis III, IV dan V.....	28
3.6.3	Pengujian Hipotesis VI, VII dan VIII.....	29

### **BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN**

4.1	Gambaran Data Penelitian .....	31
4.2	Perhitungan <i>Abnormal return</i> .....	33
4.3	Pengujian Hipotesis I.....	34
4.4	Pengujian Hipotesis II .....	39
4.5	Pengujian Hipotesis III .....	42
4.6	Pengujian Hipotesis IV .....	44
4.7	Pengujian Hipotesis V .....	45
4.8	Pengujian Hipotesis VI.....	48
4.9	Pengujian Hipotesis VII.....	50
4.10	Pengujian Hipotesis VIII .....	52

### **BAB VI PENUTUP**

5.1	Kesimpulan .....	55
5.2	Kelemahan Penelitian.....	59
5.3	Saran-Saran .....	59

<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	61
-----------------------------	----



## DAFTAR GAMBAR

	Halaman
3.1 Gambar Periode Penelitian .....	25
4.1 Gambar Rata-rata <i>Abnormal return</i> LQ-45.....	35
4.2 Gambar Rata-rata <i>Abnormal return</i> Saham Perbankan .....	39
4.3 Gambar Rata-Rata TVA LQ-45.....	48
4.4 Gambar Rata-Rata TVA Saham Perbankan .....	50

## DAFTAR TABEL

	Halaman
4.1 Daftar Perusahaan LQ-45 .....	31
4.2 Lanjutan Daftar Perusahaan LQ-45.....	32
4.3 Daftar Perusahaan Perbankan .....	33
4.4 Hasil Uji Statistik Saham LQ-45 .....	37
4.5 Hasil Uji Statistik Saham Perbankan .....	41
4.6 Hasil Uji Beda Rata-Rata <i>Abnormal return</i> Saham LQ-45 .....	43
4.7 Hasil Uji Beda Rata-Rata <i>Abnormal return</i> Saham Perbankan.....	44
4.8 Hasil Uji Beda Rata-Rata <i>Abnormal return</i> Sebelum Peristiwa Antara Saham LQ-45 dan Saham Perbankan.....	46
4.9 Hasil Uji Beda Rata-Rata <i>Abnormal return</i> Sesudah Peristiwa Antara Saham LQ-45 dan Saham Perbankan.....	47
4.10 Hasil Uji Beda Rata-Rata TVA Saham LQ-45 .....	49
4.11 Hasil Uji Beda Rata-Rata TVA Saham Perbankan.....	51
4.12 Hasil Uji Beda Rata-Rata TVA Sebelum Peristiwa Antara Saham LQ-45 dan Saham Perbankan.....	52
4.13 Hasil Uji Beda Rata-Rata TVA Sesudah Peristiwa Antara Saham LQ-45 dan Saham Perbankan.....	53