

## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Kata Pengantar.....	ii
Daftar Isi.....	iv
Daftar Tabel.....	vi
Daftar Gambar.....	vii
Daftar Lampiran.....	viii
Intisari.....	ix
<i>Abstract</i> .....	x
Bab I Pendahuluan	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	13
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	14
1.4 Tujuan Penelitian.....	14
1.5 Manfaat Penelitian.....	14
1.6 Lingkup Penelitian.....	15
1.7 Sistematika Penulisan.....	15
Bab II Landasan Teori	
2.1 Landasan Teori.....	17
A. Return Saham.....	17
B. Volume Perdagangan Saham.....	18
C. Indeks Harga Saham.....	19
D. <i>Event Study</i> (Studi Peristiwa).....	20
E. Prinsip Informasi Dalam Pasar Modal.....	20
F. Prinsip <i>Holiday Effect</i> Dalam Anomali Pasar.....	21
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis.....	22
Bab III Metode Penelitian	
3.1 Desain Penelitian.....	26
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	26
3.3 Instrumen Penelitian.....	27
3.4 Metode Analisis Data.....	28

## Bab IV Hasil Penelitian dan Pembahasan

4.1 Deskripsi Data.....	31
4.1.1 Statistik Deskriptif.....	32
A. Statistik Deskriptif Di Luar <i>Event Window</i> Imlek.....	32
B. Statistik Deskriptif Di Dalam <i>Event Window</i> Imlek....	33
4.1.2 Uji <i>Paired Sample T-Test</i> .....	35
4.1.3 Regresi Linear.....	38
4.2 Pembahasan.....	40

## Bab V Kesimpulan

5.1 Kesimpulan.....	42
5.2 Implikasi.....	42
5.3 Keterbatasan.....	43
5.4 Saran.....	44

Daftar Pustaka.....	45
---------------------	----

Lampiran.....	47
---------------	----