

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan.....	ii
Halaman Keaslian Karya Tulis	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Lampiran	xii
Daftar Singkatan.....	xiii
Intisari	xiv
<i>Abstract</i>	xv
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Batasan Penelitian.....	8
1.6 Sistematika Penulisan	9
BAB II. LANDASAN TEORI DAN LITERATUR.....	10
2.1 Penelitian Empiris tentang Efektivitas Suspensi	10
2.2 Saham dan Harga Saham	12
2.3 Suspensi	12
2.4 Volatilitas.....	13
2.4.1 <i>Absolute Return Volatility</i>	14
2.4.2 <i>Realized Volatility</i>	15
2.5 Hipotesis	16
BAB III. METODE PENELITIAN	17
3.1 Desain Penelitian.....	17

3.2 Definisi Operasional Variabel	17
3.3 Populasi dan Sampel.....	20
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	21
3.5 Teknik Analisis Data	22
BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	23
4.1 Deskripsi data	23
4.2 Uji Normalitas	25
4.2.1 Uji normalitas hipotesis I.....	25
4.2.2 Uji normalitas hipotesis II	26
4.2.3 Uji normalitas hipotesis III	26
4.2.4 Uji normalitas hipotesis IV	27
4.3 Uji hipotesis dan pembahasan	28
4.3.1 Uji hipotesis I.....	28
4.3.2 Uji hipotesis II	29
4.3.3 Uji hipotesis III	32
4.3.4 Uji hipotesis IV	35
BAB V. SIMPULAN	39
5.1 Simpulan	39
5.2 Saran.....	40
Daftar Pustaka	42

Daftar Tabel

- 3.1 Daftar sampel penelitian
- 4.1 Statistifka deskriptif
- 4.2 Uji normalitas hipotesis I
- 4.3 Uji normalitas hipotesis II
- 4.4 Uji normalitas hipotesis III
- 4.5 Uji normalitas hipotesis IV
- 4.6 Uji *wilcoxon signed-rank* hipotesis I
- 4.7 Uji *wilcoxon signed-rank* hipotesis II
- 4.8 Uji *wilcoxon signed-rank* hipotesis II
- 4.9 Uji *wilcoxon signed-rank* hipotesis II

Daftar Gambar

- 3.1 Periode pengamatan penelitian
- 4.1 Grafik RV total sampel
- 4.2 Grafik RV *small cap*
- 4.3 Grafik RV *medium cap*
- 4.4 Grafik RV *big cap*
- 4.5 Grafik RV durasi 1 hari
- 4.6 Grafik RV durasi 2-3 hari
- 4.7 Grafik RV durasi > 3 hari
- 4.8 Grafik RV berita positif
- 4.9 Grafik RV berita negatif
- 4.10 Grafik RV berita netral

Daftar Lampiran

- 1 Daftar Sampel untuk Kategori Durasi Suspensi
- 2 Daftar Sampel untuk Kategori Tipe Berita
- 3 Daftar Sampel untuk Kategori Kapitalisasi Pasar
- 4 Daftar RV keseluruhan sampel periode ± 5 hari (dalam %)

Daftar Singkatan

ARA	<i>Auto Rejection Atas</i>
ARB	<i>Auto Rejection Bawah</i>
BEI	Bursa Efek Indonesia
EMH	<i>Efficient Market Hypothesis</i>
OJK	Otoritas Jasa Keuangan
RV	<i>Realized Volatility</i>