

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
ABSTRACT	xiii
INTISARI.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1.Latar Belakang	1
1.2.Rumusan Masalah	8
1.3.Pertanyaan Penelitian	8
1.4. Tujuan Penelitian.....	9
1.5. Manfaat Penelitian.....	9
1.6. Lingkup Penelitian	9
1.7. Sistematika Penulisan.....	10
BAB II LANDASAN TEORI DAN KAJIAN PENELITIAN TERDAHULU	12
2.1.Landasan Teori	12

2.1.1. Pasar Modal	12
2.1.2. Pasar Modal Efisien.....	13
2.1.3. Hipotesis Pasar Efisien.....	14
2.1.4. Event Study	15
2.1.5. Harga dan Return Saham.....	16
2.1.6. Realized Return	16
2.1.7. Expected Return	17
2.1.8. Abnormal Return	17
2.1.9. Trading Volume Activity (TVA)	18
2.1.10. Risiko Operasional Bank.....	18
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	24
2.3. Perumusan Hipotesis	26
BAB III Metode Penelitian	28
3.1. Data dan Sumber Data.....	28
3.2. Variabel Penelitian	28
3.3. Sampel	29
3.3.2. Abnormal Return.....	35
3.3.3. Trading Volume Activity	35
3.4. Metode Analisis Data	36
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	39

4.1.Deskriptif Data Abnormal Return dan Cumulative Abnormal Return	40
4.1.2.Deskriptif Data Trading Volume Activity	43
4.2.Pengujian Hipotesis Satu.....	44
4.2.2. Pembahasan Hasil Uji Hipotesis	46
4.3.Hasil Uji Hipotesis Dua.....	46
4.3.2. Pembahasan Hasil Uji Hipotesis Dua	48
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	49
5.1.Kesimpulan.....	49
5.2..Keterbatasan Penelitian	50
5.3..Saran	51
DAFTAR PUSTAKA	52

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1. Sampel Penelitian.....	31
Tabel 4.1. Statistik Deskriptif Data <i>Abnormal Return</i>	41
Tabel 4.2. Statistik Deskriptif Data <i>Cumulative Abnormal Return</i>	42
Tabel 4.3. Statistik Deskriptif Data <i>Trading Volume Activity</i>	43
Tabel 4.4. Hasil Uji T <i>Abnormal Return</i>	44
Tabel 4.5. Hasil Uji T <i>Cumulative Abnormal Return</i>	45
Tabel 4.6. Hasil Uji T <i>Trading Volume Activity</i>	47

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i>	58
Lampiran 2. Hasil Perhitungan <i>Cumulative Abnormal Return</i>	60
Lampiran 3. Hasil Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i>	62
Lampiran 4. Statistik Deskriptif Data <i>Abnormal Return</i>	64
Lampiran 5. Uji Normalitas Data <i>Abnormal Return</i>	65
Lampiran 6. Hasil Uji T Data <i>Abnormal Return</i>	66
Lampiran 7. Statistik Deskriptif Data <i>Cumulative Abnormal Return</i>	67
Lampiran 8. Uji Normalitas Data <i>Cumulative Abnormal Return</i>	68
Lampiran 9. Uji T Data <i>Cumulative Abnormal Return</i>	69
Lampiran 10. Statistik Deskriptif Data <i>Trading Volume Activity</i>	70
Lampiran 11. Uji Normalitas Data <i>Trading Volume Activity</i>	71
Lampiran 12. Uji T Data <i>Trading Volume Activity</i>	71