

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
NASKAH SOAL TUGAS AKHIR	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
UCAPAN TERIMA KASIH	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
DAFTAR NOTASI DAN SINGKATAN	xiv
INTISARI	xvi
ABSTRACT	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Asumsi dan Batasan	3
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	5
BAB III LANDASAN TEORI	8
3.1 Pasar Modal	8
3.2 Saham	10
3.3 <i>Return</i> dan <i>Abnormal Return</i>	12
3.4 Volume Perdagangan Saham	14
3.5 Teori <i>Signaling</i>	15
3.6 Studi Peristiwa	15
3.7 Analisis Fundamental Saham	16

3.8 Anggaran Pendapatan dan Belanja Negara (APBN)	17
3.9 Uji Normalitas	18
3.10 Uji <i>One Sample T-test</i>	19
3.11 Uji <i>Paired Sample T-test</i>	19
3.12 Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	20
BAB IV METODE PENELITIAN	22
4.1 Objek Penelitian	22
4.2 Alat Penelitian	22
4.3 Data Penelitian	23
4.4 Metode Pengumpulan Data	23
4.5 Tahapan Penelitian	23
4.6 Kerangka Penelitian	26
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	28
5.1 Hasil Perhitungan Nilai <i>Abnormal Return</i> Saham	28
5.2 Analisis Deskriptif Nilai <i>Abnormal Return</i>	29
5.3 Pengujian Hipotesis <i>Abnormal Return</i>	30
5.4 Analisis Hasil Signifikansi Perbedaan <i>Abnormal Return</i>	33
5.5 Hasil Perhitungan Nilai <i>Trading Volume Activity</i>	37
5.6 Analisis Deskriptif Nilai <i>Trading Volume Activity</i>	40
5.7 Uji Hipotesis Signifikansi Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i>	40
5.8 Analisis Hasil Signifikansi Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i>	41
BAB VI PENUTUP	43
6.1 Kesimpulan	43
6.2 Saran	44
DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN	49