

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	i
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
INTISARI.....	viii
ABSTRACT	ix
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Pertanyaan Penelitian	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Kerangka Penelitian	5
BAB 2 GAMBARAN UMUM.....	6
2.1 Kajian Literatur	6
2.1.1 Pasar Modal.....	6
2.1.2 Saham	8
2.1.3 <i>Abnormal Return Saham & Trading Volume Activity</i>	11
2.1.4 Pasar Efisien	13
2.1.5 <i>January Effect</i>	15
2.1.6 IDX SMC Liquid	16
2.2 Penelitian Sebelumnya & Keaslian Penelitian	17
2.3 Hipotesis Penelitian.....	21
BAB 3 METODOLOGI PENELITIAN	22

3.1 Desain Penelitian	22
3.2 Sumber Data	22
3.3 Teknik Pengumpulan Data	23
3.4 Populasi dan Sampel	23
3.5 Definisi Operasional Variabel	25
3.5.1 Abnormal Return	25
3.5.2 Trading Volume Activity	26
3.6 Teknik Analisis Data	26
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN	31
4.1 Analisis Deskripsi dan Inferensial	31
4.1.1 Abnormal Return	32
4.1.2 Trading Volume Activity	34
4.2 Intrepretasi dan Pembahasan	36
4.2.1 Abnormal Return	36
4.2.2 Trading Volume Activity	38
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	41
5.1 Kesimpulan	41
5.2 Saran	42
DAFTAR PUSTAKA	43