

DAFTAR ISI

JUDUL	i
PERNYATAAN.....	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL.....	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
ABSTRAK	ix
ABSTRACT	x
BAB I	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.6 Lingkup penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	7
BAB II.....	9
2.1 Pasar Modal.....	9
2.2 Abnormal Return.....	10
2.3 Event Study	12
2.4 Signalling Theory.....	13
2.5 Trading Volume Activity	14
2.6 Rasio Keuangan	14
2.7 Kajian Penelitian Terdahulu.....	15
2.8 Hipotesis.....	17
BAB III	19

3.1 Desain Penelitian.....	19
3.2 Metode Pengumpulan Data	21
3.3 Instrumen Penelitian.....	22
3.4 Metode Analisis Data	23
BAB IV	27
4.1 Deskripsi Data.....	27
4.2 Pengujian Abnormal Return.....	29
4.2.1 Pengujian AR Saham Masuk LQ45	29
4.2.2 Pengujian AR Saham Keluar LQ45	31
4.3 Regresi Data	33
4.3.1 Regresi Data Saham Masuk LQ45	34
4.3.2 Regresi Data Saham Keluar LQ45	35
4.4 Pengujian Hipotesis.....	36
4.5 Diskusi dan Pembahasan.....	37
BAB V.....	40
5.1 Simpulan	40
5.2 Implikasi.....	41
5.3 Keterbatasan.....	42
5.4 Saran.....	42
DAFTAR PUSTAKA	43
DAFTAR LAMPIRAN.....	45