

## Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan Dewan Penguji.....	ii
Halaman Pengesahan Dosen Pembimbing.....	iii
Halaman Pernyataan Keaslian Skripsi.....	iv
Halaman Persembahan.....	v
Kata Pengantar.....	viii
Daftar Isi.....	x
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Tabel.....	xiv
Daftar Lampiran.....	xv
Abstrak.....	xvi
<i>Abstract</i> .....	xvii
<b>BAB I. PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Motivasi Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Kontribusi Penelitian.....	9
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	11
1.9 Sistematika Penulisan.....	11
<b>BAB II. TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>13</b>
2.1 Landasan Teori.....	13
2.1.1 Efisiensi Pasar.....	13
2.1.2 <i>Event Study</i> .....	15
2.1.3 <i>Trading Volume Activity</i> .....	18
2.1.4 <i>Abnormal Return</i> .....	18
2.2 Penelitian-Penelitian Sebelumnya.....	20

2.3	Perumusan Hipotesis dan Kerangka Berpikir .....	23
<b>BAB III. METODE PENELITIAN</b> .....		<b>26</b>
3.1	Desain Penelitian.....	26
3.1.1	Metode Penelitian .....	26
3.1.2	Dimensi Waktu .....	27
3.1.3	Unit Analisis .....	29
3.2	Definisi Operasional Variabel.....	30
3.2.1	<i>Abnormal Return</i> .....	30
3.2.2	<i>Trading Volume Activity</i> .....	31
3.2.3	Revisi Daftar Negatif Investasi.....	32
3.3	Populasi dan Sampel .....	33
3.3.1	Populasi.....	33
3.3.1	Sampel .....	34
3.4	Instrumen Penelitian.....	35
3.5	Teknik Pengumpulan Data.....	35
3.6	Teknik Analisis Data dan Uji Hipotesis.....	35
3.6.1	Hipotesis 1 .....	36
3.6.2	Hipotesis 2 .....	37
<b>BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b> .....		<b>39</b>
4.1	Deskripsi Data.....	39
4.2	Deskripsi Statistik .....	41
4.3	Uji Normalitas.....	42
4.4	Pengujian Hipotesis.....	42
4.4.1	Pengujian Hipotesis 1 .....	43
4.4.2	Pengujian Hipotesis 2 .....	47
<b>BAB V. SIMPULAN</b> .....		<b>50</b>
5.1	Simpulan .....	50
5.2	Keterbatasan.....	51
5.3	Saran.....	52

Daftar Pustaka .....	54
Lampiran .....	58