

## DAFTAR ISI

<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	8
1.3 Pembatasan Masalah.....	9
1.4 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	9
1.4.1 Tujuan Penelitian.....	9
1.4.2Kegunaan Penelitian.....	10
1.5 Kerangka Pikir.....	10
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>14</b>
2.1 Pasar Modal.....	14
2.2 Indeks Harga Saham.....	18
2.3 Saham.....	19
2.4 Efisiensi Pasar.....	19
2.5 <i>Return</i> Saham.....	22
2.6 <i>Abnormal Return</i> .....	26
2.6.1 Jenis-Jenis <i>Abnormal Return</i> .....	27
2.7 <i>Trading Volume Activity</i> .....	28
2.8 Studi Peristiwa ( <i>Event Study</i> ).....	28
2.9 <i>Quick Count</i> .....	30
2.10 Telaah Penelitian Terdahulu.....	31
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....</b>	<b>34</b>
3.1 Sifat Penelitian.....	34
3.2 Jenis Data.....	34
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	35

3.4 Objek Penelitian.....	35
3.5 Definisi Operasional Variabel.....	37
3.6 Alat Analisis.....	37
3.6.1 Analisis Kualitatif.....	37
3.6.2 Analisis Kuantitatif.....	37
3.7 Pengujian Hipotesis.....	42
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>45</b>
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	45
4.2 Hasil Penelitian.....	46
4.2.1 Pembentukan Model <i>Expected Return</i> .....	46
4.2.2 Pengujian Normalitas data pada Persamaan <i>Expected Return</i> Model CAPM.....	47
4.2.3 Perhitungan Regresi .....	50
4.2.4 Hasil Analisis <i>Actual Return</i> .....	51
4.2.5 Hasil Analisis <i>Return</i> Ekspektasi ( <i>Expected Return</i> ).....	53
4.2.6 Hasil Analisis <i>Abnormal Return</i> .....	55
4.2.7 Hasil Analisis <i>Average Abnormal Return</i> .....	58
4.2.8 Hasil Analisis <i>Trading Volume Activity</i> .....	61
4.2.9 Hasil Analisis <i>Average Trading Volume Activity</i> .....	63
4.2.10 Hasil Analisis Pengujian dengan <i>Paired Sample T-test</i> .....	65
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>71</b>
5.1 Kesimpulan.....	71
5.2 Saran.....	72

## **DAFTAR PUSTAKA**

## **LAMPIRAN**