

DAFTAR ISI

ABTRAKSI.....	i
LEMBAR BUKTI RISET.....	ii
TANDA PERSETUJUAN.....	iii
PERNYATAAN TIDAK PLAGIAT.....	iv
CURRICULUM VITAE.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Tujuan Penelitian.....	5
1.4. Manfaat Penelitian.....	6
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1. Landasan Teoritis.....	7
2.1.1 Pasar Modal.....	7
2.1.2 Efisiensi Pasar.....	8
2.1.3 <i>Event Study</i>	12
2.1.4 <i>Abnormal Return</i> dan <i>Expected Return</i>	14
2.1.5 Volume Perdagangan.....	16
2.2. Penelitian Terdahulu.....	17
2.3. Kerangka Pemikiran.....	22
2.4. Hipotesis.....	24
BAB 3 METODOLOGI PENELITIAN.....	25
3.1. Jenis Penelitian dan Sumber Data.....	25
3.2. Periode Penelitian.....	25
3.3. Populasi dan Sampel.....	25
3.4. Teknik Analisis Data.....	27

3.5. Uji Hipotesis	29
BAB 4 HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	33
4.1. Profil Objek Penelitian.....	33
4.1.1 Gambaran Umum perusahaan yang diteliti	33
1) PT. Jasa Marga (Persero) Tbk (JSMR).....	33
2) PT. Perusahaan Gas Tbk (PGAS).....	34
3) PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk (TLKM).....	35
4.2. Penyajian Data	35
4.2.1 Data Indeks Harga Saham dan <i>Market Index</i>	36
4.2.2 Data <i>Expected Return Saham</i>	36
4.2.3 Data Volume Perdagangan	38
4.3. Pengujian dan Interpretasi Hasil	39
4.3.1 Pengujian <i>Abnormal Return (H1)</i>	39
4.3.2 Uji <i>Paired Samples T Average Abnormal Return (H2)</i>	44
4.3.3 Uji <i>Paired Samples T Average Trading Volume Activity (H3)</i>	45
4.3.4 Interpretasi hasil Pengujian	46
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	50
5.1. Kesimpulan	50
5.2. Saran	51
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN	54

