

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Sampul Depan Skripsi	i
Halaman Judul Skripsi	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Pengesahan Sripsi	iv
Halaman Pengesahan Ujian Skripsi	v
Abstrak	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Isi	viii
Daftar Tabel	x
Daftar Grafik	xi
Daftar Lampiran	xii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Tujuan Penelitian	4
1.4. Manfaat Penelitian	5
1.5. Sistematika Pembahasan	5
BAB II KAJIAN PUSTAKA	
2.1. Pasar Modal Indonesia	7
2.2. Efisiensi Pasar	
2.2.1 Bentuk-Bentuk Efisiensi Pasar	8
2.2.2 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	11
2.3. Kandungan Informasi Analisis Analisis Keuangan	12
2.4. Pendekatan Analisis Sekuritas	
2.4.1 Analisis Fundamental	14
2.4.2 Analisis Teknikal	15
2.5 Tinjauan Penelitian Terdahulu	16

BAB III METODE PENELITIAN

3.1. Populasi dan Sampel	18
3.2. Data Penelitian	18
3.3. Periode Pengamatan dan Periode Estimasi	19
3.4. Definisi Operasional	
3.4.1 Abnormal Return	19
3.4.2 Volume Perdagangan Saham	21
3.5 Metode Analisis Data	
3.5.1 Pengujian Abnormal Return	22
3.5.2 Pengujian Volume Perdagangan Saham	26

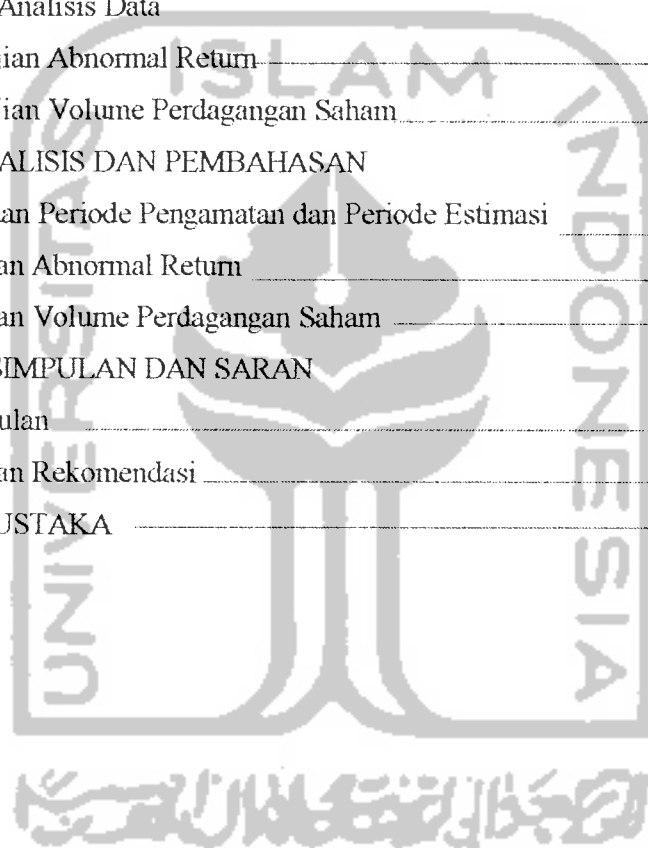
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1. Penentuan Periode Pengamatan dan Periode Estimasi	29
4.2. Pengujian Abnormal Return	30
4.3. Pengujian Volume Perdagangan Saham	35

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1. Kesimpulan	39
5.2. Saran dan Rekomendasi	41

DAFTAR PUSTAKA	43
----------------------	----



DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
4.1 Rata-Rata Abnormal Return	31
4.2 Cumulative Average Abnormal Return	33
4.3 T-Hitung dan Probabilitas	34
4.4 Hasil Uji Beda Rata-Rata TVA	37



DAFTAR GRAFIK

Grafik	Halaman
4.1 Rata-Rata Abnormal Return	32
4.2 Cumulative Average Abnormal Return	33



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Halaman
1. Tanggal Publikasi, Perusahaan yang Dianalisis, dan Isi Analisis	44
2. Abnormal Return dan CAR Perusahaan	49
3. T-Test Abnormal Return	57
4. Aktivitas Volume Perdagangan Saham	59
5. T-Test TVA	63

