

SKRIPSI.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAKSI	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.3 Tujuan Dan Kegunaan Penelitian.....	13
1.4 Sistematika Penulisan.....	14
BAB II.....	17
TELAAH PUSTAKA	17
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu.....	17
2.1.1 Signalling Theory.....	17
2.1.2 Efficiency Market Hypothesis (EMH).....	18
2.1.3 Abnormal Return.....	20
2.1.4 Trading Volume Activity	21
2.1.5 Price to Book Value	22
2.1.6 Number of Investors (NI).....	23
2.1.7 Return On Equity	24
2.1.8 Ukuran Perusahaan (<i>SIZE</i>).....	24
2.2 Penelitian Terdahulu.....	25
2.3 Pengaruh Antar Variabel Dependen dan Independen	33

2.3.1	Pengaruh Trading Volume Activity Terhadap Abnormal Return...	33
2.3.2	Pengaruh <i>Price to Book Value</i> Terhadap <i>Abnormal Return</i>	34
2.3.3	Pengaruh <i>Number of Investors</i> terhadap <i>Abnormal Return</i>	35
2.3.4	Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap <i>Abnormal Return</i>	36
2.3.5	Pengaruh Ukuran Perusahaan (<i>SIZE</i>) terhadap <i>Abnormal Return</i> ..	36
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	38
2.5	Hipotesis	38
BAB III		40
METODE PENELITIAN.....		40
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	40
3.1.1	Variabel Penelitian	40
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	41
3.2	Populasi dan Sampel	48
3.2.1	Populasi	48
3.2.2	Sampel.....	49
3.3	Jenis dan Sumber Data	51
3.4	Metode Pengumpulan Data	52
3.5	Metode Analisis Data	53
3.5.1	Uji Asumsi Klasik.....	53
3.5.2	Analisis Regresi Linear Berganda.....	57
3.5.3	Uji Hipotesis	58
BAB IV		62
HASIL DAN ANALISIS		62
4.1	Gambaran Umum dan Statistik Deskriptif	62
4.1.1	Gambaran Umum Objek Penelitian	62
4.1.2	Statistik Deskriptif	62
4.2	Uji Asumsi Klasik	68
4.2.1	Uji Normalitas.....	68
4.2.2	Uji Multikolinearitas	73
4.2.3	Uji Heteroskedastisitas.....	75
4.2.4	Uji Autokorelasi.....	77
4.3	Hasil regresi Linier Berganda.....	78

4.4	Uji Hipotesis.....	80
4.4.1	Analisis Koefisien Determinasi (R^2).....	80
4.4.2	Uji Statistik F (<i>Goodness Of Fit</i>).....	82
4.4.3	Uji Statistik Parsial (Uji t).....	86
4.4.4	Penentuan Variabel Paling Dominan	97
BAB V PENUTUP.....		101
5.1	Kesimpulan.....	101
5.2	Keterbatasan Penelitian	102
DAFTAR PUSTAKA		106
DAFTAR LAMPIRAN.....		111