

## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Surat Pernyataan Keaslian Tesis .....	ii
Halaman Pengesahan .....	iii
Motto / Persembahan.....	iv
<i>Abstract</i> .....	v
Abstraksi .....	vi
Kata Pengantar .....	vii
Daftar Tabel .....	xii
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Lampiran .....	xiv
Daftar Rumus .....	xv
<b>BAB I. PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Perumusan Masalah .....	9
1.3 Tujuan Penelitian .....	11
1.4 Kegunaan Penelitian .....	11
1.4.1 Kegunaan Teoritis .....	11
1.4.2 Kegunaan Praktik.....	11
<b>BAB II. TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL</b>	
2.1 Telaah Pustaka .....	12
2.1.1 Pasar Modal .....	13

2.1.2	Efisiensi Pasar .....	15
2.1.3	Saham LQ-45.....	16
2.1.4	Peristiwa <i>Suspend</i> BEI .....	17
2.1.5	<i>Abnormal Return</i> .....	20
2.1.6	<i>Return Saham</i> .....	20
2.1.7	<i>Expected Return</i> .....	22
2.1.8	<i>Trading Volume Activity (TVA)</i> .....	24
2.1.9	<i>Event Study</i> .....	26
2.2	Penelitian Terdahulu .....	27
2.2.1	Penelitian Terdahulu Tentang <i>Abnormal Return</i> .....	27
2.2.2	Penelitian Terdahulu Tentang TVA.....	29
2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis .....	32
2.4	Perumusan Hipotesis.....	32

### **BAB III. METODE PENELITIAN**

3.1	Jenis dan Sumber Data.....	33
3.2	Populasi dan sampel.....	33
3.3	Metode Pengumpulan Data.....	35
3.4	Definisi Operasional Variabel.....	35
3.5	Teknik Analisis .....	37
3.5.1	Teknik Analisis Event Studi .....	37
3.5.2	Periode Pengamatan .....	38
3.5.3	Pengujian Hipotesis.....	39

## **BAB IV. HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1	Deskripsi Objek Penelitian .....	46
4.2	Analisis Data .....	47
4.2.1	<i>Return</i> Saham dan <i>Return</i> Pasar .....	48
4.2.2	<i>Abnormal Return</i> .....	49
4.2.3	<i>Trading Volume Activity</i> .....	52
4.2.2	Statistik Deskriptif .....	53
4.2.3	Pengujian Normalitas Data .....	63
4.3	Pengujian Hipotesis .....	66
4.3.1	Pengujian Hipotesis Pertama .....	66
4.3.2	Pengujian Hipotesis Kedua .....	68
4.4	Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis .....	70

## **BAB V PENUTUP**

5.1	Kesimpulan .....	72
5.2	Implikasi Kebijakan .....	73
5.3	Keterbatasan Penelitian.....	74
5.4	Agenda Penelitian Mendatang .....	75

<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	75
-----------------------------	----

## **DAFTAR RIWAYAT PENELITI**