

DAFTAR ISI

DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Kesenjangan Penelitian	4
1.3. Tujuan Penelitian.....	5
1.4. Ringkasan Hasil Penelitian.....	5
1.5. Kontribusi Riset.....	6
1.6. Sistematika Skripsi	6
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1. Landasan Teori	8
2.1.1. Teori Efisiensi Pasar Modal	8
2.1.2. Teori Signalling.....	8
2.1.3. Event Study	9
2.1.4. Return Saham	10
2.1.5. Abnormal Return.....	11
2.1.6. Trading Volume Activity (TVA)	11
2.2. Penelitian Terdahulu.....	12
2.3. Kerangka Pemikiran	13
2.4. Pengembangan Hipotesis	14

2.4.1.	Abnormal Return dan Pemilu serentak 2019	14
2.4.2.	Average Abnormal Return dan Pemilu serentak 2019.....	14
2.4.3.	Average Trading Volume Activity dan Pemilu serentak 2019	15
2.4.4.	Hubungan antar Reaksi Pasar Modal	16
BAB 3 METODE PENELITIAN		17
3.1.	Sumber Data	17
3.2.	Populasi dan Sampel	17
3.3.	Periode Data Penelitian	18
3.4.	Definisi Operasional Variabel	18
3.5.1.	Identifikasi Peristiwa dan Periode Pengamatan	18
3.5.2.	Abnormal Return.....	20
3.5.3.	Trading Activity Volume	21
3.5.	Teknik Analisis Data	22
3.5.1.	Statistika Deskriptif.....	22
3.5.2.	Uji Normalitas	22
3.5.3.	Uji Hipotesis	23
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN		24
4.1.	Gambaran Umum Subjek Dan Objek Penelitian.....	24
4.2.	Pengujian dan Hasil Analisis Data	24
4.2.1.	Analisis Statistik Deskriptif	24
4.2.2.	Uji Normalitas	26
4.2.3.	Uji Hipotesis	27
4.3.	Pembahasan Hasil Analisis Data	37
4.3.1.	Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 1	37
4.3.2.	Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 2	39

4.3.3.	Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 3	40
4.3.4.	Analisis Hasil Pengujian Hipotesis 4	42
BAB 5	SIMPULAN DAN SARAN	44
5.1.	Simpulan.....	44
5.2.	Keterbatasan dan Saran	45
DAFTAR PUSTAKA	46
LAMPIRAN	48

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Tahapan pengujian hipotesis 1	22
Tabel 3.2 Tahapan pengujian hipotesis 2	23
Tabel 3.3 Tahapan pengujian hipotesis 3	24
Tabel 4.1 Hasil Statistik Deskriptif R, AR & TVA	25
Tabel 4.2 Hasil Analisis Deskriptif AAR	27
Tabel 4.3 Uji Normalitas abnormal return	27
Tabel 4.4 Uji Normalitas trading volume activity	28
Tabel 4.5 Alpha-Beta Saham Sampel	28
Tabel 4.6 Hasil Analisis One Sample T-Test Abnormal Return	32
Tabel 4.7 Hasil Analisis Paired Sample T-Test AAR	33
Tabel 4.8 Hasil Analisis Paired Sample T-Test AR	33
Tabel 4.9 Hasil Analisis Paired Sample T-Test ATVA	35
Tabel 4.10 Hasil Analisis Paired Sample T-Test TVA	36
Tabel 4.11 Hasil Analisis Multiple Comparisons Abnormal Return	37

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Fluktuasi Saham Indeks LQ-45.....	1
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Teoritis	13
Gambar 3.1 Periode waktu penelitian	19
Gambar 4.1 Abnormal Return selama Event Window.....	38
Gambar 4.2 TVA selama Event Window	42

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Penelitian Tedahulu
- Lampiran 2 Daftar Saham Sampel dan Hasil Uji Normalitas Data
- Lampiran 3 Daftar Closing Price Saham Sampel
- Lampiran 4 Perhitungan return saham dan return pasar
- Lampiran 5 Perhitungan expected return dan abnormal return
- Lampiran 6 Hasil Uji One Sample Test
- Lampiran 7 Hasil Uji Paired Sample T-Test AAR dan AR
- Lampiran 8 Daftar peredaran saham sampel
- Lampiran 9 Hasil Uji Paired Sample T-Test ATVA dan TVA
- Lampiran 10 Hasil Uji One Way ANOVA