

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRAKSI	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1 Telaah Pustaka.....	10
2.1.1 Event Study	11
2.1.2 Pasar Modal yang Efisien	13
2.1.3 Informasi di Pasar Modal	14
2.1.4 Pasar Modal	15
2.1.5 Saham LQ-45	16
2.1.6 Return	17
2.1.7 Abnormal Return	18
2.1.8 Trading Volume Activity	21
2.1.9 Pemilu Presiden dan Wakil Presiden th 2014	21
2.2 Penelitian Terdahulu	23
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis dan Pengembangan Hipotesis	27

2.3.1 Dampak Pilpres terhadap return saham	28
2.3.2 Dampak Pilpres terhadap TVA	29
2.3.3 Kerangka Teoritis	30
BAB III METODE PENELITIAN.....	31
3.1 Jenis Penelitian.....	31
3.2 Jenis dan Sumber Data	31
3.3 Populasi dan Prosedur Penentuan Sampel	32
3.4 Metode Pengumpulan Data	33
3.5 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel	33
3.6 Teknis Analisis	35
3.6.1 Analisis Diskriptif	35
3.6.2 Uji Normalitas	36
3.7 Pengujian Hipotesis	36
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Statistik Deskriptif	39
4.1.1 Deskripsi Harga Saham	40
4.1.2 Deskripsi Return Saham dan AR	41
4.1.3 Deskripsi Volume Perdagangan Saham	44
4.2 Analisis Data	46
4.2.1 Uji Normalitas Data	46
4.2.2 Pengujian Hipotesis	47
4.2.2.1 Uji Efek Pilpres terhadap AR	47
4.2.2.2 Pengujian Perbedaan AR	49
4.2.2.3 Pengujian Perbedaan TVA	50
4.3 Pembahasan	51
4.3.1 Dampak Pilpres terhadap AR saham LQ-45	51
4.3.2 Dampak Pilpres terhadap TVA saham LQ-45	52
BAB V PENUTUP.....	54
5.1 Kesimpulan.....	54
5.2 Keterbatasan	54
5.3 Saran.....	55

DAFTAR PUSTAKA	57
LAMPIRAN	