

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAKSI	vii
<i>ABSTRACT</i>	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Perumusan Masalah.....	5
C. Tujuan Penelitian.....	6
D. Manfaat Penelitian.....	6
BAB II. LANDASAN TEORI	8
A. Landasan Teoritis	8
1. Pasar Modal	10
2. Hipotesis Pasar Modal Yang Efisien	12
3. Informasi di Pasar Modal.....	12
4. Teori Market Signaling	13
5. Teori Prospek.....	16
6. Indeks Saham LQ45.....	18
7. Aktivitas Volume Perdagangan (<i>Trading Volume Activity</i>)	19
8. <i>Abnormal Return</i>	20
a. <i>Expected Return</i>	22

i.	Model Disesuaikan Rata-Rata (<i>Mean Adjusted Model</i>)	22
ii.	Model Pasar (<i>Market Model</i>)	23
iii.	Model Disesuaikan Pasar (<i>Market Adjusted Model</i>)	24
b.	<i>Actual Return</i>	25
9.	Pemilu 2014 dan Fenomena Jokowi	27
B.	Penelitian Terdahulu.....	31
C.	Kerangka Pemikiran Teoritis	34
D.	Hipotesis	35
1.	Hubungan Pemilu Presiden 2014 terhadap Volume Perdagangan Saham... 36	
2.	Hubungan Pemilu Presiden 2014 terhadap <i>Abnormal Return</i>	37
III.	METODE PENELITIAN	40
A.	Tempat dan Waktu Penelitian.....	40
B.	Jenis dan Sumber Data.....	40
C.	Populasi dan Sampel.....	42
D.	Metode Pengumpulan Data.....	45
E.	Metode Analisa.....	46
F.	Definisi Operasional Variabel	47
IV.	GAMBARAN UMUM OBJEK PENELITIAN	49
A.	Deskripsi Objek Penelitian	49
B.	Kelompok Saham LQ-45	51
1.	PT. Astra Agro Lestari Tbk	55
2.	PT. Adhi Karya (Persero) Tbk	56
3.	PT. Adaro Energi Tbk.....	57
4.	PT. AKR Corporindo Tbk.....	58
5.	PT. Astra International Tbk	59
6.	PT. Alam Sutera Realty Tbk.....	60
7.	PT. Bank Central Asia Tbk.....	61

8. PT. Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk	63
9. PT. Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk	64
10. PT. Bank Danamon Indonesia Tbk.....	65
11. PT Bank Mandiri (Persero) Tbk	67
12. PT. Global Mediacom Tbk	70
13. PT. Bumi Serpong Damai Tbk.....	71
14. PT. Charoen Pokphand Indonesia Tbk	73
15. PT. Ciputra Development Tbk.....	74
16. PT. XL Axiata Tbk	76
17. PT. Gudang Garam Tbk.....	77
18. PT. Harum Energy Tbk.....	79
19. PT. Indofood CBP Sukses Makmur Tbk	80
20. PT. Indofood Sukses Makmur Tbk.....	82
21. PT. Indocement Tunggul Prakarsa Tbk	83
22. PT. Indo Tambangraya Megah Tbk	84
23. PT. Jasa Marga (Persero) Tbk.....	85
24. PT. Kalbe Farma Tbk.....	87
25. PT. Lippo Karawaci Tbk.....	88
26. PT. PP London Sumatera Indonesia Tbk.....	89
27. PT Media Nusantara Citra Tbk	90
28. PT. Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.....	91
29. PT. Tambang Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk	93
30. PT PP (Persero) Tbk	94
31. PT. Pakuwon Jati Tbk.....	95
32. PT. Semen Gresik (Persero) Tbk	96
33. PT. Summarecon Agung Tbk	98
34. PT. Express Transindo Utama Tbk.....	100

35. PT. Tower Bersama Infrastructure Tbk	100
36. PT. Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk	101
37. PT. United Tractors Tbk	103
38. PT. Unilever Indonesia Tbk.....	105
39. PT. Wijaya Karya (Persero) Tbk	107
40. PT. Waskita Karya (Persero) Tbk.....	110
V. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	113
A. Volume Perdagangan Saham (<i>Trading Volume Activity – TVA</i>).....	113
1. Analisis Deskriptif Transaksi Perdagangan Saham (TVA) Sebelum dan Sesudah Pemilu Presiden 2014	113
2. Pengujian Hipotesis Volume Perdagangan Saham (TVA)	116
B. <i>Abnormal Return</i>	121
1. Analisis Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pemilu Presiden 2014.....	121
2. Pengujian Hipotesis <i>Abnormal Return</i>	123
VI. PENUTUP	129
A. Kesimpulan	129
B. Saran	131
DAFTAR PUSTAKA	133
LAMPIRAN.....	135