

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Tujuan dan Kegunaan.....	5
1.4. Sistematika Penulisan.....	6
BAB II.....	9
2.1. Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu	9
2.1.1. Teori Efisiensi Pasar	9
2.1.2. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	11
2.1.3. Reaksi Pasar	13
2.1.4. Penelitian Terdahulu	16
2.2. Kerangka Pemikiran	26
2.3. Pengembangan Hipotesis	28
2.3.1. Hubungan Kejadian Luar Biasa Covid dan <i>Abnormal Return</i>	28
2.3.2. Hubungan Kejadian Luar Biasa Covid dan <i>Trading Volume Activity</i> 30	
BAB III	31
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	31
3.1.1. Variabel : <i>Abnormal Return</i>	31
3.1.2. Variabel : <i>Trading Volume Activity</i>	33

3.2.	Populasi dan Sampel	34
3.2.1.	Populasi.....	34
3.2.2.	Sampel.....	35
3.3.	Jenis dan Sumber Data	36
3.4.	Periode Data	36
3.5.	Metode Pengumpulan Data	38
3.6.	Metode Analisis.....	38
3.6.1.	Statistika Deskriptif	39
3.6.2.	Uji Normalitas.....	39
3.6.3.	Uji Hipotesis	40
BAB IV	45
4.1.	Deskripsi Objek Penelitian.....	45
4.1.1.	Indeks Kompas 100.....	45
4.2.	Analisis Data	46
4.2.1.	Statistik Deskriptif	46
4.3.	Uji Normalitas	53
4.4.	Uji Hipotesis.....	55
4.4.1.	Abnormal Return Saham Pada Hari Sekitar Pengumuman Kejadian Luar Biasa Covid di Indonesia.....	55
4.4.2.	Perbedaan Abnormal Return Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kejadian Luar Biasa Covid di Indonesia	58
4.4.3.	Perbedaan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kejadian Luar Biasa Covid Di Indonesia.....	61
4.5.	Interpretasi Hasil	63
BAB V	68
5.1.	Simpulan.....	68
5.2.	Keterbatasan	69
5.3.	Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN-LAMPIRAN	75

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	23
Tabel 4. 1 Kriteria Sampel Penelitian	46
Tabel 4. 2 Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham Harian untuk Seluruh Sampel pada Periode Jendela	47
Tabel 4. 3 Statistik Deskriptif Rata-Rata <i>Trading Volume Activity</i> untuk Seluruh Sampel Saham Sebelum dan Sesudah Peristiwa.....	51
Tabel 4. 4 Hasil Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	53
Tabel 4. 5 Hasil Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	54
Tabel 4. 6 Hasil Analisis Signifikansi Rata-Rata Abnormal Return Saham Selama Periode Pengamatan (<i>One Sample T Test</i> dan <i>One Sample Wilcoxon Signed Rank Test</i>).....	56
Tabel 4. 7 Hasil uji <i>abnormal return wilcoxon signed rank test</i>	58
Tabel 4. 8 Hasil uji abnormal return per sektor dengan <i>paired sample t test</i>	60
Tabel 4. 9 Hasil uji abnormal return per sektor dengan <i>wilcoxon signed rank test</i>	60
Tabel 4. 10 Hasil uji <i>trading volume activity wilcoxon signed rank test</i>	62

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN A DATA SAMPEL PENELITIAN.....	75
LAMPIRAN B DATA ACTUAL RETURN SAHAM	78
LAMPIRAN C DATA EXPECTED RETURN SAHAM	82
LAMPIRAN D DATA ABNORMAL RETURN SAHAM	86
LAMPIRAN E DATA TRADING VOLUME ACTIVITY SAHAM.....	91
LAMPIRAN F HASIL OLAH DATA.....	96