

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
1.5 Sistematika Penulisan.....	10
BAB II TELAAH PUSTAKA.....	12
2.1 LANDASAN TEORI	12
2.1.1 Teori Efisiensi Pasar.....	12
2.1.2 Terorisme Salah Satu Penyebab Disaster	17
2.1.3 Sentimen Investor.....	18
2.2 Penelitian Terdahulu.....	19
2.3 Hubungan Antara Variabel dan Kerangka Pemikiran Teoritis.....	32
2.3.1 Pengaruh Peristiwa Terorisme terhadap Pasar Saham Asia	32

2.3.2	Pengaruh Peristiwa Terorisme terhadap reaksi Sentimen Investor ...	33
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis	34
2.5	Hipotesis	36
BAB III METODE PENELITIAN		37
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	37
3.1.1	Variabel Penelitian	37
3.1.2	Definisi Operasional.....	38
3.2	Populasi dan Sampel.....	41
3.2.1	Populasi.....	41
3.2.2	Sampel	41
3.3	Jenis dan Sumber Data	43
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	43
3.5	Metode Analisis	43
3.6	Model Analisis	44
BAB IV HASIL PENELITIAN		45
4.1	Deskripsi Objek Penelitian	45
4.2	Analisis Data.....	45
4.2.1	Statistik Deskriptif.....	45
4.2.2	Uji Normalitas.....	49
4.3	Hasil Uji Hipotesis	50
4.3.1	Abnormal Return Peristiwa Terorisme Bali di Indonesia.....	50
4.3.2	Abnormal Return Peristiwa Terorisme Super Ferry di Filipina.....	53
4.3.3	Abnormal Return Peristiwa Terorisme Hat Yai di Thailand	55
4.3.4	Sentimen Investor Peristiwa Terorisme Bali di Indonesia.....	57

4.3.5	Sentimen Investor Peristiwa Terorisme Super Ferry di Filipina.....	60
4.3.6	Sentimen Investor Peristiwa Terorisme Hat Yai di Thailand	62
4.4	Pembahasan.....	64
4.4.1	Pembahasan Pengaruh Terorisme di ASEAN terhadap Abnormal Return Pasar Saham Asia	64
4.4.2	Pembahasan Pengaruh Terorisme di ASEAN terhadap Sentimen Investor Asia.....	65
BAB V PENUTUP		66
5.1	Kesimpulan	66
5.2	Keterbatasan Penelitian	66
5.3	Saran Penelitian.....	67
5.3.1	Bagi Akademisi dan Penelitian Selanjutnya	67
DAFTAR PUSTAKA.....		68
LAMPIRAN		71