

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
ABSTRAK	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	10
1.4 Sistematika Penulisan	12
BAB II.....	13
TELAAH PUSTAKA	13
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu	13
2.1.1 Pasar Modal	13
2.1.2 Hipotesis Efisiensi Pasar	15
2.1.3 <i>Signalling Theory</i>	16
2.1.4 <i>Event Study</i>	17
2.1.5 <i>Abnormal Return</i>	17
2.1.6 <i>Trading Volume Activitiy</i>	18
2.1.7 Penelitian Terdahulu.....	18
2.1.8 Perbedaan atau Kesamaan Penelitian Terdahulu dengan Penelitian Sekarang	35
2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	35
2.3 Perumusan Hipotesis	38

BAB III	40
METODOLOGI PENELITIAN.....	40
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	40
3.1.1 Variabel Dependen	40
3.1.2 Variabel Independen.....	43
3.1.1 Definisi Operasional Variabel	44
3.2 Populasi dan Sampel.....	45
3.2.1 Populasi	45
3.2.2 Sampel	45
3.3 Periode Penelitian.....	47
3.4 Jenis dan Sumber Data	48
3.4 Metode Pengumpulan Data	48
3.5 Metode Analisis Data	48
3.6.1 Analisis Deskriptif.....	49
3.6.2 Analisis Statistik Data	49
3.6.3 Uji Asumsi Klasik	50
3.6.4 Uji Hipotesis.....	50
BAB IV	52
HASIL PENELITIAN DAN ANALISIS DATA.....	52
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	52
4.1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	52
4.1.2 Statistik Deskriptif.....	52
4.2 Analisis Data.....	54
4.2.1 Uji Normalitas Data.....	54
4.3 Uji Hipotesis.....	57
4.3.1 Uji Paired Sample T-test.....	57
4.3.2 Uji Wilcoxon Signed Rank.....	59
4.4 Interpretasi Hasil.....	61
4.4.1 Pengaruh Peristiwa Pengumuman Pemberlakuan Kebijakan PPKM Darurat Jawa-Bali tahun 2021 Terhadap Abnormal Return.....	61

4.4.2 Pengaruh Peristiwa Pengumuman Pemberlakuan Kebijakan PPKM Darurat Jawa-Bali tahun 2021 Terhadap Trading Volume Activity (TVA)	62
4.4.3 Pengaruh Peristiwa Pengumuman Pemberlakuan Kebijakan PSBB Pertama DKI Jakarta tahun 2020 Terhadap Abnromal Return.....	63
4.4.4 Pengaruh Peristiwa Pengumuman Pemberlakuan Kebijakan PSBB Pertama DKI Jakarta tahun a 2020 Terhadap Trading Volume Activity (TVA)	64
BAB V.....	66
PENUTUP.....	66
5.1 Kesimpulan.....	66
5.2 Keterbatasan Penelitian	69
5.3 Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN.....	75

FEB UNDIP