

DAFTAR ISI

JUDUL	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	Error! Bookmark not defined.
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	11
1.4 Manfaat Penelitian	11
1.5 Sistematika Penulisan	12
BAB II TELAAH PUSTAKA	16
2.1 Landasan Teori	16
2.1.1 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	16
2.1.2 Teori/Hipotesis Efisiensi Pasar	17
2.1.3 Teori Pensinyalan (<i>Signaling Theory</i>)	18
2.1.4 <i>Return Saham</i> (Imbal Hasil Saham)	18
2.1.5 Imbal Hasil Abnormal (<i>Abnormal Return</i>)	20
2.2 Penelitian Terdahulu	20
2.3 Perumusan Hipotesis	23

2.2 Kerangka Pemikiran.....	25
BAB III METODE PENELITIAN.....	27
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasiona	27
3.1.1 Variabel Penelitian	27
3.1.2 Definisi Operasional Variabel.....	27
3.2 Jenis dan Sumber Data.....	29
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	30
3.4 Populasi dan Sampel	30
3.4.1 Populasi.....	30
3.4.2 Sampel.....	31
3.5 Metode Analisis Data.....	31
3.5.1 Uji statistik deskriptif.....	31
3.5.2 Pengujian Hipotesis.....	31
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....	33
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	33
4.2 Analisis Data	33
4.2.1. Analisis Deskriptif	33
4.2.3. Hasil Uji Hipotesis	35
4.3 Interpretasi Hasil	46
4.3.1 Pengaruh pengumuman kasus COVID-19 Indonesia pertama terkonfirmasi terhadap imbal hasil abnormal indeks saham emiten sembilan sektor 46	
4.3.2 Pengaruh kebijakan PSBB (<i>lockdown</i>) di Indonesia terhadap imbal hasil abnormal sembilan indeks sektor saham emiten	50
BAB V PENUTUP.....	56
5.1 Kesimpulan	56
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	59
5.3 Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA	62
LAMPIRAN	65