

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSETUJUAN	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv

BAB I : PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Permasalahan.....	1
B. Rumusan Masalah.....	14
C. Tujuan Penelitian	14
D. Manfaat Penelitian	15

BAB II : TINJAUAN PUSTAKA

A. Landasan Teori	16
1. Studi Peristiwa	16
2. Teori Signal	20
3. Pasar Modal	22
4. Saham	22
5. Reaksi Pasar.....	24
6. Efisiensi Pasar.....	25
7. <i>Abnormal Return</i>	29
8. <i>Trading Volume Activity</i>	31
9. Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB).....	32
B. Penelitian Terdahulu	34

C. Hubungan Antar Variabel.....	36
D. Kerangka Penelitian.....	38
E. Hipotesis Penelitian.....	40
BAB III : METODE PENELITIAN	
A. Rancangan Penelitian.....	41
B. Objek Penelitian.....	42
C. Populasi Penelitian.....	42
D. Sampel Penelitian.....	42
E. Periode Pengamatan.....	44
F. Jenis Data Penelitian.....	46
G. Prosedur Pengambilan Data.....	46
H. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Penelitian.....	47
I. Teknik Analisis Data.....	50
BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Analisis Deskriptif.....	56
B. Analisis Data.....	69
1. Pengujian Hipotesis 1.....	69
2. Pengujian Hipotesis 2.....	71
C. Pembahasan.....	72
BAB V : KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	78
B. Saran.....	79
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	34
Tabel 3.1 Sampel Penelitian.....	43
Tabel 4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	57
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	63
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Abnormal Return</i>	70
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Trading Volume Activity</i>	71

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Grafik Pergerakan Indeks Manufaktur Sebelum PSBB	9
Gambar 1.2	Grafik Pergerakan Indeks Manufaktur Sesudah PSBB	10
Gambar 2.1	Kerangka Penelitian	39
Gambar 3.1	Periode Jendela 11 hari	45
Gambar 4.1	Grafik Pergerakan <i>Abnormal Return</i>	58
Gambar 4.2	Grafik Pergerakan <i>Trading Volume Activity</i>	64

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran I : Sampel Penelitian.....	84
Lampiran II : Uji Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	85
Lampiran III : Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	86
Lampiran IV : Uji Wilcoxon Signed Rank Test <i>Abnormal Return</i>	86
Lampiran V : Uji Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	87
Lampiran VI : Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	87
Lampiran VII : Uji Wilcoxon Signed Rank Test <i>Trading Volume Activity</i>	88

