

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
MOTTO.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRAK.....	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
A. Landasan Teori.....	9
1. Pengertian Pasar Modal	9
2. Manfaat Keberadaan Pasar Modal	11
3. Fungsi Pasar Modal	12
4. Karakteristik Pasar Modal.....	13
5. Emiten dan Perusahaan Publik.....	14
6. Instrumen Pasar Modal	16
7. Pengertian Saham	17

8. Jenis Saham.....	18
9. <i>Return</i>	29
10. Komponen <i>Return</i>	21
11. <i>Realized Return</i>	21
12. <i>Expected return</i>	22
13. <i>Abnormal Return</i>	22
14. <i>Trading Volume Activity</i>	23
B. Penelitian Terdahulu.....	24
C. Kerangka Konseptual atau Kerangka Penelitian.....	26
D. Hipotesis Penelitian.....	28
BAB III METODE PENELITIAN	29
A, Rancangan Penelitian	29
B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	31
C. Populasi dan Sampel.....	32
D. Jenis Data Penelitian.....	33
E. Prosedur Penambilan Data	33
F. Definisi Operasional Variabel	34
G. Teknik Analisis	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	47
A. Hasil Penelitian	47
B. Pembahasan.....	63
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	66
A, Kesimpulan	66
B. Saran	67
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	70

DAFTAR TABEL

4.1 Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dengan Sealama Pandemi Covid-19.....	42
4.2 Statistik Deskriptif <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Selama Pandemi Covid-19.....	44
4.3 Hasil Perhitungan <i>Trading Volume Activty</i> Sebelum Pandemi Covid-19	47
4.4 Statistik Deskriptif <i>Average Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Selama Pandemi Covid-19.....	49
4.5 Hasil Uji Normalitas Data <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	51
4.6 Hasil Uji Normalitas Data <i>Average Trade Volume Activity</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	52
4.7 Hasil <i>One Sample t-Test Abnormal Return</i> Sebelum dengan Pandemi Covid-19	53
4.8 Hasil Uji <i>Paired Sample t-Test Abnormal Return</i>	55
4.9 Hasil Uji <i>Mann Whitney Average Trading Volume Activity</i>	56

DAFTAR GAMBAR

2.1 Kerangka Konseptual	17
3.1 Periode Jendela	22
4.1 Grafik <i>Abnormal Return</i> Sebelum Pandemi Covid-19.....	40
4.2 Grafik <i>Abnormal Return</i> Selama Pandemi Covid-19.....	41
4.3 Grafik <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum Pandemi Covid-19.....	45
4.4 Grafik <i>Trading Volume Activity</i> Selama Pandemi Covid-19.....	46

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Perhitungan <i>Return</i> Saham Sebelum Pandemi Covid 19 (Dalam %)	71
Lampiran 2: Perhitungan <i>Return</i> Saham Selama Pandemi Covid 19 (Dalam %)	76
Lampiran 3: Perhitungan <i>Return</i> Pasar (<i>IDX Manufacture</i>)	
Sebelum Pandemi Covid 19 (Dalam %)	81
Lampiran 4: Perhitungan <i>Return</i> Pasar (<i>IDX Manufacture</i>)	
Selama Pandemi Covid 19 (Dalam %).....	82
Lampiran 5: Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Saham	
Sebelum Pandemi Covid 19 (Dalam %)	83
Lampiran 6: Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Saham	
Selama Pandemi Covid 19 (Dalam %)	88
Lampiran 7: Perhitungan <i>Average Abnormal Return</i>	
Sebelum Pandemi Covid-19 (Dalam %)	93
Lampiran 8: Perhitungan <i>Average Abnormal Return</i>	
Selama Pandemi Covid-19 (Dalam %)	95
Lampiran 9: Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i>	
Sebelum Pandemi Covid 19 (Dalam %)	97
Lampiran 10: Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i>	
Selama Pandemi Covid 19 (Dalam %)	102

Lampiran 10: Tabel Populasi.....	107
Lampiran 11: Tabel Perusahaan Yang Tidak Memenuhi Kriteria Sampel	108
Lampiran 12: Gambar Grafik <i>Abnormal Return</i> Sebelum Pandemi Covid-19	108
Lampiran 13: Gambar Grafik <i>Abnormal Return</i> Selama Pandemi Covid-19	109
Lampiran 14: Tabel Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19.....	110
Lampiran 15: Tabel Statistik Deskriptif <i>Average Trading Volume Activity (%)</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	111
Lampiran 16: Tabel Statistik Deskriptif <i>Average Trading Volume Activity (%)</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	111
Lampiran 17: Gambar Grafik <i>Trading Volume Activity</i> Selama Pandemi Covid-19	112
Lampiran 18: Tabel Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19.....	107
Lampiran 19: Tabel Statistik Deskriptif <i>Average Trading Volume Activity (%)</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	115
Lampiran 20: Tabel Hasil Uji Normalitas Data <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	115
Lampiran 21: Tabel Hasil Uji Normalitas Data <i>Average Trade Volume Activity</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	115

Lampiran 22: Tabel Hasil <i>One Sample T-Test Abnormal Return</i> Sebelum dengan Selama Pandemi Covid-19	116
Lampiran 23: Tabel Hasil Uji <i>Paired Sample T-Test Average Abnormal Return</i>	117
Lampiran 24: Tabel Hasil Uji <i>Mann Whitney Average Trading Volume Activity</i>	117