

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULISAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
MOTTO	vi
ABSTRAK	vii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
A.Latar Belakang Permasalahan	1
B. Rumusan Masalah.....	7
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
1. Bagi Investor dan Calon Investor	8
2. Bagi Penelitian Selanjutnya	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
A. Landasan Teori	9
1. Efisiensi Pasar Modal	9
2. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	10
3. Teori Asimetri Informasi (<i>Asymetry Information Theory</i>).....	11
4. Pasar Modal	12
4.1 Defenisi Pasar Modal	12
4.2 Manfaat Pasar Modal.....	13
4.3 Tipe Tipe Pasar Modal	13
4.4 Instrumen Pasar Modal (Sekuritas)	14
5. <i>Return Saham</i>	16
6. <i>Abnormal Return</i>	16
7. <i>Trading Volume Activity</i>	19

8. <i>Event Study</i>	20
9. Putusan mahkamah konstitusi mengenai sengketa hasil pemilu 2024 ..	21
B. Penelitian Terdahulu.....	23
C. Kerangka Konseptual/ Kerangka Penelitian.....	26
D. Hipotesis Penelitian.....	27
BAB III METODE PENELITIAN	28
A. Rancangan Penelitian	28
B. Objek dan Waktu Penelitian	28
C. Populasi	30
D. Sampel dan Teknik Sampling.....	30
E. Jenis dan Sumber Data.....	31
F. Prosedur Pengambilan Data	32
G. Variable Penelitian dan Definisi Operasional Variable	32
1. <i>Abnormal Return</i>	33
2. <i>Trading Volume Activity</i>	33
H. Teknik Analisis Data	34
1. Statistik Deskriptif.....	34
2. Statistik Inferensial.....	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	43
A. Hasil Penelitian	43
1. Statistik Deskriptif.....	43
2. Statistik Inferensial	47
1. Pengujian Hipotesis 1	47
2. Pengujian Hipotesis 2	49
3. Pengujian Hipotesis 3	50
B. Pembahasan.....	52
a. Terdapat reaksi pasar sebelum dan setelah Peristiwa Pengumuman Putusan Mahkamah Konstitusi Mengenai Sengketa Hasil Pemilu 2024 .	52
b. Perbedaan Abnormal Return Sebelum dan Sesudah Peristiwa Pengumuman Putusan Mahkamah Konstitusi Mengenai Sengketa Hasil Pemilu 2024	54

c. Perbedaan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Peristiwa Pengumuman Putusan Mahkamah Konstitusi Mengenai Sengketa Hasil Pemilu 2024	55
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	57
A. Kesimpulan	57
B. Saran	57
1. Bagi Investor	57
2. Bagi peneliti selanjutnya	58
DAFTAR PUSTAKA	59
LAMPIRAN.....	62

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	24
Tabel 3. 1 Defenisi Variabel	28
Tabel 4. 1 Hasil Perhitungan AAR 1	44
Tabel 4. 2 Tabel Perhitungan ATVA 1	45
Tabel 4. 3 Descriptive Statistics.....	46
Tabel 4. 4 Uji Normalitas Abnormal Return	47
Tabel 4. 5 Uji Signifikan Abnormal Return Menggunakan One Sample t-test dan dan one sample wilcoxon signed ranked test.....	48
Tabel 4. 6 Uji Normalitas Average Abnormal Return	49
Tabel 4. 7 Uji Wilxocon Signed Rank Test	50
Tabel 4. 8 Uji Normalitas Average Trading Volume Activity	50
Tabel 4. 9 Uji Wilxocon Signed Rank Test	51

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Grafik IHSG selama periode peristiwa	4
Gambar 1. 2 Grafik LQ-45 selama periode peristiwa.....	4
Gambar 2. 1 Jenis Sekuritas di Indonesia.....	11
Gambar 2. 2 Kerangka Pemikiran.....	27
Gambar 3.1 <i>Event Study</i>	22
Gambar 4. 1 Grafik <i>Average Abnormal Return</i>	43
Gambar 4. 2 Grafik <i>Average Trading Volume Activity</i>	45

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. 1 Daftar Perusahaan yang Masuk pada Indeks LQ-45 PeriodeFebruari 2024- Juli2024.....	63
Lampiran 1. 2 Perhitungan <i>Abnormal Return</i>	64
Lampiran 1. 3 Perhitungan <i>Average Abnormal Return</i>	86
Lampiran 1. 4 Perhitungan <i>Trading Volume Activity</i>	87
Lampiran 1. 5 Perhitungan <i>Average Trading Volume Activity</i>	103
Lampiran 1. 6 Hasil Perhitungan Analisis Deskriptif	104
Lampiran 1. 7 Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	104
Lampiran 1. 8Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	105
Lampiran 1. 9 <i>One sample t-test abnormal return</i>	105
Lampiran 1. 10 . Uji <i>Wilcoxon Signed Rank TestAverage Abnormal Return</i> ...	106
Lampiran 1. 11. Uji <i>Wilcoxon Signed Rank TestAverage Trading Volume Activity</i>	106