

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Masalah.....	2
1.3 Perumusan Masalah.....	10
1.4 Tujuan Penelitian.....	11
1.5 Manfaat Penelitian.....	11
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	12
BAB II TINJAUAN PERPUSTAKAAN.....	14
2.1 Teori Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu.....	14
2.1.1 Investasi	14
2.1.2 Alasan Melakukan Investasi dan Dasar Keputusan Investasi.....	15
2.1.3 Pasar Modal	16
2.1.4 Indeks Pasar Modal.....	18
2.1.5 Efisiensi Pasar.....	21

2.1.6	<i>Event Study</i>	23
2.1.7	<i>Abnormal return</i>	26
2.1.8	<i>Trading Volume Activity</i>	29
2.1.9	Penelitian Terdahulu	29
2.2	Kerangka Pemikiran	36
2.3	Hipotesis Penelitian	37
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		39
3.1	Jenis Penelitian	39
3.2	Operasional Variabel	40
3.3	Tahapan Penelitian	42
3.4	Populasi dan Sampel	45
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	47
3.6	Teknik Analisis Data	48
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		54
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Trading Volume Activity</i>	54
4.1.1	<i>Abnormal Return</i>	54
4.1.2	<i>Trading Volume Activity</i>	55
4.2	Statistik Deskriptif.....	56
4.2.1	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham Sub-Sektor Farmasi.....	56
4.2.2	Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i> Saham Sub-Sektor Farmasi	63
4.3	Pengujian Hipotesis	69
4.3.1	Uji Normalitas Data	70
4.3.2	Uji Beda Sampel yang Berhubungan (<i>Paired Sample T-Test</i>)	75
4.3.3	Uji <i>Wilcoxon</i>	80

4.4	Pembahasan Hasil Penelitian.....	83
4.4.1	<i>Abnormal Return</i> Saham Sub-Sektor Farmasi pada Peristiwa Pengumuman Uji Vaksin COVID-19	83
4.4.2	<i>Trading Volume Activity</i> Saham Sub-Sektor Farmasi pada Peristiwa Pengumuman Uji Vaksin COVID-19	85
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		87
5.1	Kesimpulan.....	87
5.2	Saran	88
5.2.1	Aspek Teoritis	88
5.2.2	Aspek Praktis	89
DAFTAR PUSTAKA		91
LAMPIRAN.....		95