

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN .....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>vi</b>
<b><i>ABSTRACT</i> .....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1      Gambaran Umum Objek Penelitian .....	1
1.2      Latar Belakang Penelitian .....	3
1.3      Perumusan Masalah .....	7
1.4      Tujuan Penelitian .....	8
1.5      Manfaat Penelitian .....	9
1.6      Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	9
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>11</b>
2.1      Teori-Teori Penelitian dan Penelitian Terdahulu.....	11
2.1.1    Investasi .....	11
2.1.2    Pasar Modal .....	11

2.1.3	Efisiensi Pasar Modal .....	13
2.1.4	Analisis Saham .....	14
2.1.5	<i>Event Study</i> .....	15
2.1.6	<i>Abnormal Return</i> .....	15
2.1.7	<i>Trading Volume Activity</i> .....	18
2.1.8	Penelitian Terdahulu.....	19
2.2	Kerangka Pemikiran.....	28
2.3	Hipotesis Penelitian.....	30
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>		<b>31</b>
3.1	Jenis Penelitian.....	31
3.2	Operasional Variabel.....	32
3.3	Tahapan Penelitian .....	34
3.4	Populasi dan Sampel .....	36
3.4.1	Populasi .....	36
3.4.2	Sampel .....	36
3.5	Pengumpulan Data .....	39
3.6	Teknik Analisis Data.....	40
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>		<b>44</b>
4.1	Hasil Perhitungan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Trading Volume Activity</i> .....	44
4.1.1	<i>Abnormal Return</i> .....	44
4.1.2	<i>Trading Volume Activity</i> .....	45
4.2	Statistik Deskriptif .....	45
4.2.1	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Kelompok Saham LQ45 .....	46
4.2.2	Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i> Kelompok Saham LQ45 .....	48
4.3	Pengujian Hipotesis.....	50
4.3.1	Uji Normalitas .....	50
4.3.2	Uji Beda Sampel yang Berhubungan ( <i>Paired Sample T-Test</i> ).....	52

4.3.3	Uji Wilcoxon .....	54
4.4	Pembahasan Hasil Penelitian .....	55
4.4.1	<i>Abnormal Return</i> Kelompok Saham Indeks LQ45 pada Peristiwa Pengumuman Kasus Pertama Virus Corona di Indonesia.....	55
4.4.2	<i>Trading Volume Activity</i> Kelompok Saham Indeks LQ45 pada Peristiwa Pengumuman Kasus Pertama Virus Corona di Indonesia.....	56
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>		<b>58</b>
5.1	Kesimpulan .....	58
5.2	Saran.....	58
5.2.1	Aspek Teoritis.....	59
5.2.2	Aspek Praktis .....	59
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>60</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>64</b>