

# DAFTAR ISI

<b>KATA PENGANTAR.....</b>	
DAFTAR ISI.....	i
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Pembatasan Masalah.....	14
1.4 Tujuan Penelitian .....	15
1.5 Manfaat Penelitian .....	15
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>17</b>
2.1 Kerangka Teoritis.....	17
2.1.1 Teori sinyal ( <i>Signaling Theory</i> ) .....	17
2.1.2 <i>Event Study</i> .....	17
2.1.3 Pasar Modal.....	19
2.1.4 Pasar Modal Efisien .....	20
2.1.4 Return Saham.....	22
2.1.5 Abnormal Return.....	27
2.1.6 Trading Volume Activity .....	31
2.2 Penelitian yang Relevan.....	34
2.3 Kerangka Berfikir .....	38
2.4 Hipotesis .....	40
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>41</b>
3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian .....	41
3.2 Populasi dan Sampel.....	41
3.2.1 Populasi.....	41
3.2.2 Sampel.....	41
3.3 Variabel Penelitian dan Defenisi Operasional .....	44
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	45
3.5 Teknik Analisis Data.....	46

3.5.1 Metode Analisis Event Study.....	46
3.5.2 Analisis Statistik Deskriptif .....	48
3.5.3 Uji Asumsi .....	49
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>52</b>
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian .....	52
4.1.1 Bursa Efek Indonesia .....	52
4.2 Hasil Penelitian .....	55
4.2.3 Uji Hipotesis .....	67
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian .....	72
4.3.1 Perbedaan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kasus Covid-19 .....	72
4.3.2 Perbedaan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Penyuntikan Vaksin Covid-19 .....	76
4.3.3 Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kasus Covid-19 .....	79
4.3.4 Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Penyuntikan Vaksin Covid-19 .....	81
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>83</b>
5.1 Kesimpulan .....	83
5.2 Saran .....	84
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>86</b>
<b>Lampiran .....</b>	<b>90</b>