

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN .....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN .....	iv
KATA PENGANTAR .....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL .....	xi
KATA PENGANTAR .....	i
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR LAMPIRAN.....	vii
INTISARI.....	viii
ABSTRACT .....	ix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	4
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	4
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Teori Pasar Efisien .....	7
2.2 Studi Peristiwa.....	9
2.3 Indeks Sektoral .....	9
2.4 Penelitian Terdahulu.....	10
2.5 Pengembangan Hipotesis .....	11
BAB III METODA PENELITIAN .....	13
3.1 Sampel dan Data Penelitian.....	13
3.1.1 Sampel Penelitian.....	13

3.1.2	Data Penelitian .....	15
3.1.3	Teknik Pengumpulan Data.....	15
3.2	Definisi Operasional.....	15
3.2.1	Studi Peristiwa .....	15
3.2.2	Return Saham Harian .....	17
3.2.3	Return Pasar Harian .....	17
3.2.4	Return Tak Normal .....	18
3.2.5	Return Tak Normal Kumulatif.....	18
3.2.6	Rata-Rata Return Tak Normal Kumulatif.....	19
3.2.7	t-test.....	19
3.3	Pengujian Hipotesis Pertama.....	20
3.4	Pengujian Hipotesis Kedua.....	21
BAB IV ANALISIS HASIL PENELITIAN.....		23
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	23
4.2	Pengujian Hipotesis Pertama.....	24
4.2.1	Statistik Deskriptif .....	24
4.2.2	Uji Normalitas.....	27
4.2.3	Hasil Pengujian Hipotesis Pertama .....	29
4.3	Pengujian Hipotesis Kedua.....	32
4.3.1	Statistik Deskriptif .....	32
4.3.2	Uji Normalitas.....	33
4.3.3	Hasil Pengujian Hipotesis Kedua.....	35
4.4	Pembahasan .....	37
4.4.1	Pembahasan Hipotesis Pertama.....	37
4.4.2	Pembahasan Hipotesis Kedua .....	39
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		41
5.1	Kesimpulan.....	41
5.2	Keterbatasan Penelitian .....	41
5.3	Saran.....	42
DAFTAR PUSTAKA .....		43
LAMPIRAN.....		46

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Indeks Sektoral.....	12
Tabel 2.2 Penelitian Terdahulu .....	13
Tabel 4.1 Daftar Sampel .....	26
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Periode Penelitian Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	27
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Periode Penelitian Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta .....	28
Tabel 4.4 Hasil One Sample Kolmogorov-Smirnov Test Periode Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	30
Tabel 4.5 Hasil One Sample Kolmogorov-Smirnov Test Periode Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta.....	31
Tabel 4.6 One Sample t-test dan Uji Tanda pada Periode Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	32
Tabel 4.7 One Sample t-test dan Uji Tanda pada periode Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta.....	34
Tabel 4.8 Statistik Deskriptif <i>mean CAR</i> Periode Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	35
Tabel 4.9 Statistik Deskriptif Pengujian <i>mean CAR</i> Periode Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta.....	36
Tabel 4.10 Hasil One Sample Kolmogorov-Smirnov <i>mean CAR</i> Periode Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	37
Tabel 4.11 Hasil One Sample Kolmogorov-Smirnov <i>mean CAR</i> Periode Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta.....	37
Tabel 4.12 Paired Sample t-test <i>mean ACAR</i> Periode Pengumuman Kasus Pertama COVID-19 di Indonesia .....	38
Tabel 4.13 Paired Sample t-test <i>mean CAR</i> Periode Pengumuman Pelaksanaan PSBB Pertama di DKI Jakarta .....	39

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Perusahaan.....	46
Lampiran 2 Statistik Deskriptif Periode 1.....	47
Lampiran 3 Statistik Deskriptif Periode 2.....	48
Lampiran 4 Hasil Uji Normalitas Periode 1.....	49
Lampiran 5 Hasil Uji Normalitas Periode 2.....	50
Lampiran 6 One Sample T-test Periode 1 .....	51
Lampiran 7 One Sample T-test Periode 2 .....	52
Lampiran 8 Paired Sample T-test Periode 1 .....	55
Lampiran 9 Paired Sample T-test Periode 2 .....	56

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik Pergerakan IHSG 2019-2020.....	6
--	---