UNIVERSITAS
GADJAH MADA
REAKSI PASAR SAHAM DI INDONESIA PADA FENOMENA INFLUENCER SAHAM DALAM PENGAMBILAN KEPUTUSAN INVESTASI
Monica Anggun Setyaningrum, Jogiyanto Hartono M, Prof., Dr., MBA., Ak., CMA., CA.
Universitas Gadjah Mada, 2024 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI iii
KATA PENGANTAR iv
DAFTAR ISI vi
DAFTAR GAMBAR viii
DAFTAR TABEL ix
DAFTAR LAMPIRAN x
ABSTRAK xi
ABSTRACT xii
BAB I 1
PENDAHULUAN 1
1.1 Latar Belakang 1
1.2 Rumusan Masalah 7
1.3 Pertanyaan Penelitian 7
1.4 Tujuan Penelitian 8
1.5 Manfaat Penelitian 8
1.6 Lingkup Penelitian 9
1.7 Sistematika Penulisan 10
BAB II 12
TINJAUAN PUSTAKA 12
2.1 Landasan Teori 12
2.1.1 Investasi 12
2.1.2 Pasar Modal 13
2.1.3 Pasar Efisien 14
2.1.4 Behavioral Finance 16
2.1.5 Perilaku *Herding* 17
2.1.6 Studi Peristiwa (*Event Study*) 20
2.1.7 *Abnormal Return* 21
2.1.8 *Influencer* 21
2.2 Penelitian Terdahulu 22
2.3 Pengembangan Hipotesis 26
BAB III 31
METODE PENELITIAN 31
3.1 Desain Penelitian 31

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
REAKSI PASAR SAHAM DI INDONESIA PADA FENOMENA INFLUENCER SAHAM DALAM PENGAMBILAN KEPUTUSAN INVESTASI
Monica Anggun Setyaningrum, Jogiyanto Hartono M, Prof., Dr., MBA., Ak., CMA., CA.
Universitas Gadjah Mada, 2024 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

3.2 Data dan Sampel 32
3.3 Instrumen Penelitian 33
3.3.1 Definisi Operasional 33
3.3.2 Periode Pengamatan *Abnormal Return* 36
3.4 Metode Analisis Data 36
3.4.1 Pengujian Abnormal Return 36
BAB IV 40
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 40
4.1 Deskripsi Data 40
4.2 Hasil Statistik Deskriptif 44
4.3 Pengujian Hipotesis 45
4.3.1 Hasil Pengujian Hipotesis I 45
4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis IIa 49
4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis IIb 54
4.4 Diskusi dan Pembahasan 57
BAB V 66
SIMPULAN 66
5.1 Simpulan 66
5.2 Keterbatasan 68
5.3 Saran 69
DAFTAR PUSTAKA 71
LAMPIRAN 75