

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGAJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Tujuan.....	7
1.4 Kegunaan Penelitian.....	7
II. TINJAUAN PUSTAKA DAN LANDASAN TEORI	8
2.1 Tinjauan Pustaka.....	8
2.2 Landasan Teori.....	10
2.2.1 Pasar Modal.....	10
2.2.2 Saham.....	12
2.2.3 Indeks Saham Bursa Efek Indonesia.....	14
2.2.4 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	15
2.2.5 <i>Abnormal Return</i>	16
2.2.6 Faktor yang Memengaruhi Harga Saham.....	19
2.3 Kerangka Berpikir.....	21
2.4 Hipotesis.....	23
III. METODE PENELITIAN	24
3.1 Metode Dasar.....	24
3.2 Metode Penentuan Data.....	24
3.3 Jenis Data.....	26
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	26
3.5 Asumsi dan Pembatasan Masalah.....	26



3.6	Definisi dan Pengukuran Variabel	27
3.7	Metode Analisis Data	28
3.7.1	Pengujian Hipotesis 1	28
3.7.2	Pengujian Hipotesis 2	32
3.7.3	Pengujian Hipotesis 3	34
IV.	GAMBARAN UMUM	40
4.1	Indeks Saham Gabungan Perusahaan Sektor Pertanian saat COVID-19	40
4.2	Perkembangan Indeks Saham Gabungan Perusahaan Sektor Pertanian	43
4.3	Perkembangan Laju PDB Indonesia	44
4.4	Perkembangan Suku Bunga Indonesia	46
4.5	Perkembangan Inflasi Indonesia	47
4.6	Perkembangan Kurs USD terhadap Rupiah	48
V.	HASIL DAN PEMBAHASAN	50
5.1	Statistik Deskriptif	50
5.1.1	<i>Abnormal Return</i> pada Periode Peristiwa	50
5.1.2	Faktor yang Memengaruhi Indeks Saham Gabungan Perusahaan Sektor Pertanian.....	51
5.2	Pengujian Hipotesis 1	52
5.2.1	Hasil Pengujian Hipotesis 1	52
5.3	Pengujian Hipotesis 2	65
5.3.1	Uji Normalitas	65
5.3.2	Hasil Pengujian Hipotesis 2	66
5.4	Pengujian Hipotesis 3	68
5.4.1	Uji Asumsi Klasik	68
5.4.2	Hasil Pengujian Hipotesis 3	72
VI.	KESIMPULAN DAN SARAN	81
6.1	Kesimpulan	81
6.2	Saran	81
	DAFTAR PUSTAKA	83
	LAMPIRAN	87