

Daftar Isi

Halaman Pengesahan	i
Lembar Persetujuan	ii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis Skripsi.....	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	ix
Daftar Grafik.....	x
Daftar Gambar	xi
Daftar Lampiran.....	xii
Intisari	xiii
<i>Abstract</i>	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Batasan Penelitian.....	7
1.6 Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1. Tinjauan Pustaka.....	9
2.1.1 Studi Peristiwa (<i>event study</i>).....	9
2.1.2 Efisiensi Pasar	11
2.1.3 Pasar Modal Indonesia	14
2.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	16
2.1.5 Nilai Saham.....	16
2.1.6 Return Realisasian (<i>realized return</i>).....	17
2.1.7 Return Ekspektasian.....	18

2.1.8 Return Taknormal (<i>abnormal return</i>)	19
2.1.9 Signalling Theory.....	19
2.1.10 Google Trends.....	20
2.2 Penelitian Terdahulu	21
2.3 Pengembangan Hipotesis	22
BAB III METODE PENELITIAN	23
3.1 Desain Penelitian	23
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	24
3.2.1 Variabel independen	25
3.2.2 Variabel dependen	26
3.3 Periode Observasi	26
3.3.1 Periode Estimasi.....	27
3.3.2 Periode Jendela (<i>window period</i>).....	27
3.4 Teknik Analisis Data.....	29
3.4.1 Menghitung return realisasian (<i>realized return</i>)	29
3.4.2 Menghitung return normal (<i>normal return</i>) atau return ekspektasian (<i>expected return</i>)	29
3.4.3 Menghitung return taknormal (<i>abnormal return</i>)	31
3.5 Teknik Pengujian Hipotesis	32
3.6 Jenis Data dan Uji Asumsi Klasik.....	32
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	34
4.1 Deskripsi Data.....	34
4.1.1 Statistik Deskriptif	34
4.1.2 Pengujian Normalitas.....	35
4.1.3 Pengujian Linieritas	36
4.2 Analisis Data.....	37
4.2.1 Google Trend	37
4.2.2 Abnormal Return	40
4.3 Pengujian Hipotesis	43
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	48
5.1 Kesimpulan	48



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**EFEK VIRAL TAGAR PADA GOOGLE TREND TERHADAP ABNORMAL RETURN HARIAN SAHAM PT
NIPPON INDOSARI CORPINDO**

TBK.

IMANUEL A R GINTINGS, Gunawan Wibisono, S.E., M.Acc., CA.,

Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

5.2 Keterbatasan Penelitian.....	49
5.3 Rekomendasi untuk Penelitian Selanjutnya.....	50
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN.....	56

Daftar Tabel

Tabel 2.1 Jumlah Emiten pada Bursa Efek Indonesia.....	16
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif untuk Google dan Return Taknormal ROTI.....	34
Tabel 4.2 Hasil Uji One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test.....	36
Tabel 4.3 Tabel ANOVA Hasil Uji Linieritas	37
Tabel 4.4 Nilai Volume Pencarian pada Google Trend	38
Tabel 4.5 Abnormal Return Saham PT Nippon Indosasri Corpindo Tbk.....	41
Tabel 4.6 Tabel Hasil Regresi.....	43
Tabel 4.7 Hasil Pengujian Statistik-t Abnormal Return ROTI.....	45

Daftar Grafik

Grafik 4.1 Pergerakam Volume Pencarian Tagar #BoikotSariRoti	39
Grafik 4.2 Pergerakan Abnormal Return Pada Periode Peristiwa	42

Daftar Gambar

Gambar 2.1 Kandungan Informasi Suatu Pengumuman.....	11
Gambar 3.1 Panjang Periode Estimasi dan Periode Jendela.....	28

Daftar Lampiran

Lampiran 1. Output Histogram	56
Lampiran 2. Normal P-P Plot Regression Standardized	57
Lampiran 3. Tanggal Peristiwa-Peristiwa Penting.....	58
Lampiran 4. Data Pencarian pada Google Trend Berdasarkan Hari.....	59
Lampiran 5. Data Pencarian pada Google Trend Berdasarkan Lokasi	60
Lampiran 6. Data Pada Periode Estimasi.....	61
Lampiran 7. Data Pada Periode Jendela.....	64
Lampiran 8. Statistik Dekskriptif Periode Estimasi.....	65
Lampiran 9. Expected Return dan Abnormal Return pada Periode Jendela.....	66
Lampiran 10. Hasil Pengujian Normalitas	67
Lampiran 11. Hasil Pengujian Linieritas	68
Lampiran 12. Hasil Regresi.....	69