

DAFTAR ISI

Lembar Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	viii
Daftar Gambar	ix
Daftar Lampiran	x
Intisari	xi
<i>Abstract</i>	xii
BAB I	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	6
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian	7
1.5 Manfaat Penelitian	8
1.6 Lingkup Penelitian	8
1.7 Sistematika Penelitian	9
BAB II	11
2.1 Tinjauan Pustaka	11
2.1.1 Pasar Modal Efisien	11
2.1.2 Pasar Modal	12
2.1.3 Studi Peristiwa	13
2.1.4 <i>Abnormal return</i>	15
2.1.5 <i>Contagion Effect</i>	16
2.2 Tinjauan Penelitian Terdahulu	19
2.3 Pengembangan Hipotesis	20
Bab III	21
3.1 Desain Penelitian	21



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

REAKSI PASAR MODAL INDONESIA TERHADAP PERISTIWA PENGUMUMAN PENYEBARAN
COVID-19 DI REPUBLIK RAKYAT
TIONGGOK SEBAGAI MITRA DAGANG TERBESAR INDONESIA: STUDI PERISTIWA PADA INDEKS
LQ45

NAUFAL ARIQ RAMADHAN, Zaki Baridwan, Prof., Dr., M.Sc.,

Universitas Gadjah Mada, 2020 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

3.2 Jenis Data dan Pemilihan Sampel	22
3.3 Instrumen Penelitian.....	25
3.3.1 <i>Abnormal return</i>	25
3.3.2 <i>Average Abnormal return</i>	26
3.3.3 <i>Cumulative Abnormal return</i>	27
3.3.4 <i>Cumulative Average Abnormal return</i>	27
3.3.5 Periode Peristiwa	28
3.4 Metode Analisis Data	28
3.4.1 Langkah Pengujian Hipotesis 1	29
3.4.2 Langkah Pengujian Hipotesis 2	30
BAB IV	32
4.1 Deskripsi Data	32
4.2 Pengujian Hipotesis 1	33
4.3 Pengujian Hipotesis 2.....	36
4.3.1 Uji Normalitas	36
4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis 2.....	37
4.4 Diskusi dan Pembahasan.....	38
BAB V	41
5.1 Simpulan.....	41
5.2 Implikasi.....	42
5.3 Keterbatasan	42
5.4 Saran.....	43
Daftar Pustaka.....	44

DAFTAR TABEL

3.1 Peristiwa Pengumuman Kasus Pertama Korban Positif COVID-19.....	22
3.2 Data Sampel Emiten Indeks LQ45.....	23
4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif <i>Abnormal return</i> Peristiwa 1	28
4.2 Hasil Uji <i>One Sample T-Test</i>	32
4.3 Hasil Uji <i>Kolmogorov-Smirnov Test</i>	34
4.4 Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Ranks Test</i>	37
4.5 Hasil Uji <i>Wilcoxon Test Statistics</i>	38

DAFTAR GAMBAR

1.1 10 Negara Mitra Dagang Utama Indonesia 2019.....	2
4.1 Pergerakan <i>Cumulative Average Abnormal return</i>	35

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Nilai <i>Abnormal Return</i> pada Haris Peristiwa	43
Lampiran Hasil Uji Statistik Deskriptif	51
Lampiran Hasil Uji <i>One Sample T-Test</i>	51
Lampiran Hasil Uji <i>Kolmogorov-Smirnov Test</i>	52
Lampiran Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed-Rank Test</i>	52