

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
SURAT KETERANGAN SKRIPSI	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GRAFIK.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	4
1.5 Batasan Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Efisiensi Pasar Moda	7
2.2 Saham Indeks Liquid 4	10
2.3 <i>Abnormal</i> Return	13
2.4 Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis	14
2.5 Keterkaitan peristiwa politik 4 November 2016 terhadap aktivitas pasar modal dan Pengembangan Hipotesis	15



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Pengaruh Peristiwa Demostrasi 4 November 2016 Terhadap Abnormal Return pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (Studi Pada Kelompok Perusahaan LQ 45 di Bursa Saham Indonesia)

CHELVIANITA KUSNANDRA SAPUTRI, Irfan Nursasmito Drs.,Ak.,M.Si.

Universitas Gadjah Mada, 2017 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

BAB III METODA PENELITIAN

3.1 Identifikasi Peristiwa yang Diteliti	18
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian	19
3.3 Jenis Data dan Teknik Pengumpulan Data	20
3.4 Periode Pengamatan	20
3.5 Metoda Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	20

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Analisis Deskriptif	23
4.2 Hasil Uji Asumsi	26
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis	28

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan	34
5.2 Keterbatasan Penelitian	35
5.3 Saran	36

DAFTAR PUSTAKA	37
-----------------------------	-----------

Daftar Tabel

2.1 Daftar perusahaan sampel yang termasuk dalam ILQ-45	11
4.1 Hasil Deskriptif Rata-rata <i>Abnormal Return</i> Harian	24
4.2 Hasil Deskriptif Rata-rata dan Standar Deviasi <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Setelah peristiwa aksi demo 4 November 2016	25
4.3 Uji Normalitas Data Variabel <i>Abnormal Return</i> One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test	26
4.4 Uji Homogenitas Data Variabel <i>Abnormal Return</i> <i>Test of Homogeneity of Variances</i>	27
4.5 Hasil nilai t Hitung <i>Abnormal Return</i> Harian	28
4.6 Hasil Uji t terhadap <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Setelah Peristiwa Aksi Demo 4 November 2016	31

Daftar Grafik

4.1	Grafik <i>Abnormal return</i> Harian Selama Periode Peristiwa	30
-----	---	----

Daftar Lampiran

1. Hasil Deskriptif	39
2. Hasil Uji Normalitas dan Homogenita	40
3. Hasil Uji one sample t-test	41
4. Hasil Uji Paired t test	42