

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL DEPAN.....	i
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSETUJUAN	iv
HALAMAN PENGESAHAN	v
RIWAYAT HIDUP	vi
PERSEMBAHAN.....	vii
MOTTO	viii
ABSTRAK	ix
KATA PENGANTAR.....	xi
DAFTAR ISI	xiii
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR GAMBAR	xvii
DAFTAR RUMUS	xviii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xix

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Ruang Lingkup Penelitian	4
1.3 Rumusan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Masalah.....	5
1.5 Manfaat Penelitian	6
1.6 Sistematika Penulisan	6

BAB II LANDASAN TEORI

2.1 Teori Efisiensi Pasar	8
2.2 Study Peristiwa (<i>event Study</i>)	9
2.3 Peristiwa COVID-19.....	9
2.4 <i>Abnormal Return</i>	10

2.5 Frekuensi Perdagangan	12
2.6 <i>Market Capitalization</i>	12
2.7 Penelitian Terdahulu	13
2.8 Kerangka Pemikiran	15
2.9 Bangunan Hipotesis	15
2.9.1 <i>Abnormal Return</i>	15
2.9.2 Frekuensi Perdagangan.....	16
2.9.3 <i>Market Capitalization</i>	17

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Sumber Data	18
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	18
3.3 Populasi dan Sampel.....	19
3.3.1 Populasi	19
3.3.2 Sampel	19
3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	19
3.4.1 Variabel Penelitian	19
3.4.2 Definisi Operasional Variabel	20
3.4.2.1 <i>Abnormal Return</i>	20
3.4.2.2 Frekuensi Perdagangan.....	21
3.4.2.3 <i>Market Capitalization</i>	22
3.5 Metode Analisis Data.....	22
3.6 Pengujian Hipotesis	23
3.6.1 Uji-t Berpasangan	23
3.6.2 <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	23

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskripsi Data.....	24
4.1.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	24
4.1.2 Deskripsi Sampel Penelitian.....	25
4.2 Hasil Analisis Data	25

4.3 Hasil Pengujian Hipotesis	28
4.3.1 Uji-t Berpasangan	28
4.3.2 <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	29
4.4 Pembahasan	30
4.4.1 Pengaruh <i>abnormal return</i> sebelum dan setelah pengumuman kasus pertama Virus Corona di Indonesia pada Perusahaan Transportasi yang terdaftar di BEI.....	30
4.4.2 Pengaruh frekuensi perdagangan sebelum dan setelah pengumuman kasus pertama Virus Corona di Indonesia pada Perusahaan Transportasi yang terdaftar di BEI.....	31
4.4.3 Pengaruh <i>market capitalization</i> sebelum dan setelah pengumuman kasus pertama Virus Corona di Indonesia pada Perusahaan Transportasi yang terdaftar di BEI.....	31

BAB V PENUTUP

5.1 Kesimpulan	33
5.2 Saran	33

DAFTAR PUSTAKA	35
-----------------------------	-----------

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	13
Tabel 4.1 Prosedur dan Hasil Pemilihan Sampel	24
Tabel 4.2 Hasil Analisis Deskriptif	26
Tabel 4.2.1 Hasil Pengujian Normalitas	27
Tabel 4.3 Hasil Uji-t Berpasangan	28
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Wilcoxon</i>	29

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	15
--	-----------

DAFTAR RUMUS

Rumus <i>return</i> sesungguhnya	20
Rumus <i>expected return</i>	21
Rumus <i>abnormal return</i>	21
Rumus <i>market capitalization</i>	22

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Sampel Perusahaan

Lampiran 2 Hasil Analisis Deskriptif

Lampiran 3 Hasil Pengujian Normalitas

Lampiran 4 Hasil Uji-t Berpasangan

Lampiran 5 Hasil Uji *Wilcoxon*

Lampiran 6 Tabel Wilcoxon nilai α

