

## DAFTAR ISI

|                           |      |
|---------------------------|------|
| HALAMAN JUDUL .....       | i    |
| PERNYATAAN.....           | ii   |
| HALAMAN PERSETUJUAN ..... | iii  |
| HALAMAN PENGESAHAN.....   | iv   |
| RIWAYAT HIDUP .....       | v    |
| PERSEMBAHAN.....          | vi   |
| MOTTO .....               | vii  |
| ABSTRAK .....             | viii |
| ABSTARCT.....             | ix   |
| Kata Pengantar .....      | x    |
| DAFTAR ISI.....           | xiii |
| DAFTAR TABEL .....        | xvi  |

### BAB I PENDAHULUAN

|                                    |   |
|------------------------------------|---|
| 1.1 Latar Belakang .....           | 1 |
| 1.2 Ruang Lingkup Penelitian ..... | 5 |
| 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 Grand Theory .....  | 9  |
| 2.1.1 Studi Peristiwa ( <i>Event Study</i> ) .....                            | 9  |
| 2.2 <i>Abnormal Return</i> .....  | 10 |
| 2.3 <i>Trading Volume Activity</i> .....                                      | 11 |
| 2.4 Peristiwa Pengumuman Penyebaran Pandemi Virus Corona<br>Di Indonesia..... | 11 |
| 2.5 Penelitian Terdahulu .....  | 12 |
| 2.6 Kerangka Pemikiran .....  | 14 |
| 2.7 Bangunan Hipotesis.....   | 14 |

|  |    |
|--|----|
| 2.7.1 Hubungan Antara Perbedaan <i>Average Abnormal Return</i> Pada Perusahaan Indeks LQ45 Terhadap Sebelum Dan Sesudah Peristiwa Pengumuman Penyebaran Pandemi Virus Corona Di Indonesia .....        | 14 |
| 2.7.2 Hubungan Antara Perbedaan <i>Average Trading Volume Activity</i> Pada Perusahaan Indeks LQ45 Terhadap Sebelum Dan Sesudah Peristiwa Pengumuman Penyebaran Pandemi Virus Corona Di Indonesia..... | 15 |

### **BAB III METODOLOGI PENELITIAN**

|  |    |
|--|----|
| 3.1 Sumber data.....   | 17 |
| 3.2 Metode Pengumpulan Data .....                              | 17 |
| 3.3 Populasi Dan Sampel .....                                  | 18 |
| 3.3.1 Populasi .....   | 18 |
| 3.3.2 Sampel.....  | 18 |
| 3.4 Variabel Penelitian Dan Definisi Operasional Variabel..... | 18 |
| 3.4.1 <i>Abnormal Return</i> .....                             | 18 |
| 3.4.2 <i>Trading Volume Activity</i> .....                     | 20 |
| 3.5 Metode Anilisa Data.....                                   | 21 |
| 3.5.1 Uji Analisis Statistik Deskriptif .....                  | 21 |
| 3.5.2 Uji Normalitas .....                                     | 21 |
| 3.6 Pengujian Hipotesis .....                                  | 22 |
| 3.6.1 Uji <i>Paired Sample T-Test</i> .....                    | 22 |
| 3.6.2 Uji <i>Wilcoxo Signed Rank Test</i> .....                | 23 |

### **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

|                                       |    |
|---------------------------------------|----|
| 4.1 Deskripsi Data.....               | 25 |
| 4.1.1 Deskripsi Objek Penelitian..... | 25 |
| 4.1.2 Populasi Dan Sampel .....       | 25 |
| 4.1.3 Teknik Pengumpulan Data.....    | 26 |
| 4.1.4 Sumber Data.....                | 26 |

|   |           |
|---|-----------|
| 4.2 Hasil Analisis Data.....                  | 26        |
| 4.2.1 Uji Analisis Statistik Deskriptif ..... | 26        |
| 4.2.2 Uji Normalitas .....                    | 28        |
| 4.3 Hasil Pengujian Hipotesis .....           | 29        |
| 4.3.1 Uji Wilcoxon Signed Rank Test .....     | 29        |
| 4.4 Pembahasan.....                           | 30        |
| 4.4.1 Hasil Pengujian Hipotesis $H_1$ .....   | 30        |
| 4.4.2 Hasil Pengujian Hipotesis $H_2$ .....   | 31        |
| <b>BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....</b>          | <b>33</b> |
| 5.1 Simpulan .....                            | 33        |
| 5.2 Saran.....                                | 33        |
| 5.3 Keterbatasan .....                        | 34        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>                   | <b>35</b> |

## DAFTAR TABEL

|   |    |
|---|----|
| Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....                            | 13 |
| Tabel 3.1 Rumus Menghitung <i>Abnormal Return</i> .....         | 20 |
| Tabel 3.2 Rumus Menghitung <i>Trading Volume Activity</i> ..... | 22 |
| Tabel 4.1 Prosedur Pemilihan Sampel .....                       | 25 |
| Tabel 4.2 Statistik Deskriptive .....                           | 27 |
| Tabel 4.3 Uji Normalitas .....                                  | 28 |
| Tabel 4.4 hasil Uji Normalitas .....                            | 29 |
| Tabel 4.5 Uji <i>Wilcooxn Signed Rank Test</i> .....            | 29 |
| Tabel 4.6 Hasil Penelitian .....                                | 30 |