

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
ABSTRAK.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Gambaran Umum	1
1.2. Latar Belakang	1
1.3. Rumusan Masalah.....	6
1.4. Tujuan Penelitian.....	6
1.5. Manfaat Penelitian.....	7
1.5.1. Aspek Teoritis.....	7
1.5.2. Aspek Praktis	7
1.6. Sistematika Penulisan	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1. Teori dan Penelitian Terdahulu	9
2.1.1. Pasar Modal	9
2.1.2. Investasi	10
2.1.3. SAHAM.....	12
2.1.4. Efisiensi Pasar	13
2.1.5. Return Saham.....	15
2.1.6. Event Study.....	17
2.1.7. Indeks Saham	17
2.1.8. Penelitian Terdahulu.....	18

2.2.	Kerangka Pemikiran	27
2.3.	Hipotesis Penelitian	29
BAB III	METODE PENELITIAN	30
3.1.	Jenis Penelitian	30
3.2.	Operasional Variabel	31
3.3.	Tahapan Penelitian	33
3.4.	Populasi dan Sampel	34
3.4.1.	Populasi	34
3.4.2.	Sampel	34
3.5.	Pengumpulan Data dan Sumber Data	35
3.6.	Teknik Analisis Data	37
3.6.1.	Statistik Deskriptif.....	37
3.6.2.	Event Study.....	37
3.6.3.	Uji Normalitas.....	38
3.6.4.	Uji <i>Wilcoxon Test</i>	39
3.6.5.	Uji Beda Dua Sampel	40
3.6.6.	Pengujian Hipotesis	41
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	43
4.1.	Analisis Deskriptif.....	43
4.1.1.	Return Individual BIST 100 (Turkey).....	45
4.1.2.	Return Individual BVSP (Brazil)	47
4.1.3.	Return Individual Merval (Argentina)	48
4.1.4.	Return Individual JCI (Indonesia).....	49
4.1.5.	Return Individual SSE 50 (China)	50
4.1.6.	Return Individual BSE (India)	51
4.1.7.	Return Individual JSE.JO (Afrika Selatan)	52
4.2.	Hasil Analisis Event Study.....	52
4.2.1.	<i>Abnormal Return dan Cumulative Abnormal Return</i>	53
4.2.2.	Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> dan <i>Cumulative Abnormal Return</i> sebelum dan sesudah invasi Rusia-Ukraina.....	56

4.2.3. Perbandingan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Cumulative Abnormal Return</i> sebelum dan sesudah invasi Rusia-Ukraina.....	57
4.2.4. Perbandingan Rata-rata <i>Abnormal Return</i> sebelum dan sesudah invasi Rusia-Ukraina secara keseluruhan	60
4.2.4.1. Uji Normalitas Data.....	60
4.2.4.2. Uji Perbandingan <i>Average Abnormal Return</i> (AAR).....	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	65
5.1. Kesimpulan	65
5.1.1. Pergerakan Return Saham.....	Error! Bookmark not defined.
5.1.2. Perbedaan <i>Abnormal Return</i> dan <i>Cumulative Abnormal Return</i>	Error! Bookmark not defined.
5.2. Saran	66
DAFTAR PUSTAKA.....	68