

## DAFTAR ISI

Halaman Sampul Depan Skripsi .....	i
Halaman Judul Skripsi .....	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme.....	iii
Halaman Pengesahan Skripsi.....	iv
Halaman Pengesahan Ujian .....	v
Halaman Persembahan.....	vi
Halaman Motto .....	vii
Abstrak.....	viii
Kata Pengantar .....	x
Daftar Isi .....	xiii
Daftar Tabel .....	xvi
Daftar Lampiran.....	xvii
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang Masalah .....	1
1.2. Rumusan Masalah Penelitian.....	8
1.3. Tujuan Penelitian .....	9
1.4. Manfaat Penelitian .....	9
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA.....</b>	<b>11</b>

2.1. Pasar Modal .....	11
2.2. Efisiensi Pasar.....	11
2.3. Efisiensi Bentuk Setengah Kuat dan <i>Event Study</i> .....	16
2.4. Informasi Politik dan Reaksi Investor .....	18
2.5. Perbedaan <i>Return</i> Saham Sebelum, Pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden Amerika Serikat ke-45 .....	20
2.6. Perbedaan Volume Perdagangan Saham Sebelum, Pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden Amerika Serikat ke-45 .....	23
2.7. Perbedaan Variabilitas Tingkat Keuntungan Saham Sebelum, Pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden Amerika Serikat ke-45 .....	25
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>28</b>
3.1. Populasi dan Sampel.....	28
3.2. Data dan Sumber Data .....	28
3.3. Definisi Operasional Variabel Penelitian .....	29
3.4. Pengujian Hipotesis .....	33
3.4.1. Hipotesis 1, Hipotesis 3 dan Hipotesis 4 .....	33
3.4.2. Hipotesis 2 .....	34
<b>BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>36</b>
4.1. Statistik Deskriptif Variabel Penelitian .....	36
4.2. Pengujian Hipotesis .....	37

4.2.1. Hasil Uji Hipotesis 1 .....	38
4.2.2. Hasil Uji Hipotesis 2.....	40
4.2.3. Hasil Uji Hipotesis 3.....	42
4.2.4. Hasil Uji Hipotesis 4.....	43
4.3. Pembahasan .....	45
4.3.1. <i>Actual Return</i> pada Peristiwa Terpilihnya Donald Trump .....	46
4.3.2. <i>Abnormal Return</i> pada Peristiwa Terpilihnya Donald Trump.....	47
4.2.3. Volume Perdagangan Saham pada Peristiwa Terpilihnya Donald Trump.....	50
4.2.4. Variabilitas Tingkat Keuntungan pada Peristiwa Terpilihnya Donald Trump.....	51
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>54</b>
5.1. Kesimpulan.....	54
5.2. Saran .....	55
Daftar Pustaka.....	56
Lampiran.....	59

## DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Statistik Deskriptif Variabel Penelitian .....	36
Tabel 4.2. Hasil Uji <i>Paired Sample t-Test Average Actual Return</i> Sebelum, pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden AS ke-45 .....	39
Tabel 4.2. Hasil Uji <i>One Sample t-Test Average Abnormal Return</i> Sebelum, pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden AS ke-45 .....	40
Tabel 4.3. Hasil Uji <i>Paired Sample t-Test Average Trading Volume Activity</i> Sebelum, pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden AS ke-45 .....	42
Tabel 4.4. Hasil Uji <i>Paired Sample t-Test Average Security Return Variability</i> Sebelum, pada Saat dan Sesudah Peristiwa Terpilihnya Donald Trump sebagai Presiden AS ke-45 .....	44

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Daftar Sampel Saham Indeks LQ45 Periode Agustus 2016-Januari 2017 .....	59
Lampiran 2	Harga Saham ( <i>Close Price</i> ) Indeks LQ45 .....	61
Lampiran 3	<i>Actual Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	69
Lampiran 4	<i>Abnormal Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	79
Lampiran 5	Jumlah Saham yang diperdagangkan Indeks LQ45 .....	89
Lampiran 6	Jumlah Saham yang Beredar Indeks LQ45 .....	99
Lampiran 7	Volume Perdagangan Saham Indeks LQ45 .....	113
Lampiran 8	Varian dari <i>Actual Return</i> pada Periode Estimasi .....	123
Lampiran 9	Variabilitas Tingkat Keuntungan Saham Indeks LQ45 .....	128
Lampiran 10	Pengujian Hipotesis <i>Actual Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	133
Lampiran 11	Pengujian Hipotesis <i>Abnormal Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	135
Lampiran 12	Pengujian Hipotesis Volume Perdagangan Saham Indeks LQ45 .....	137
Lampiran 13	Pengujian Hipotesis Variabilitas Tingkat Keuntungan Saham Indeks LQ45 .....	139
Lampiran 14	Statistik Deskriptif Variabel Penelitian .....	141
Lampiran 15	Hasil Pengujian Hipotesis <i>Actual Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	142
Lampiran 16	Hasil Pengujian Hipotesis <i>Abnormal Return</i> Saham Indeks LQ45 .....	144

Lampiran 17 Hasil Pengujian Hipotesis Volume Perdagangan Saham Indeks	
LQ45 .....	145
Lampiran 18 Pengujian Hipotesis Variabilitas Tingkat Keuntungan Saham Indeks	
LQ45 .....	147

