

Daftar Isi

BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Batasan Penelitian	6
1.6 Sistematika Penulisan	7
BAB II	8
KAJIAN PUSTAKA	8
2.1 Saham	8
2.1.1 Pengertian Saham	8
2.1.2 Harga Saham	8
2.1.3 Jenis Harga Saham	9
2.2 Return Saham	10
2.2.1 Jenis Return Saham	11
2.2.2 Komponen Return Saham	12
2.2.3 Abnormal Return	13
2.3 Volatilitas	14
2.4 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	15
2.5 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Saham	16
2.6 Event-Event yang Mempengaruhi Return dan Volatilitas Saham	16
2.7 Perang Dagang	18
2.7.1 Latar Belakang Perang Dagang	18
2.7.2 Alur Waktu Perang Dagang	18
2.8 Dampak Penerapan Kebijakan US terkait Perang Dagang bagi Indonesia	20
2.9 Event Study	21
2.10 Efficient Market Hypothesis (EMH)	22
2.11 Asymmetric Information Theory	23
2.12 Support and Resistance (S/R) Lines	24
2.13 Pengembangan Hipotesis	24
BAB III	26

METODOLOGI PENELITIAN	26
3.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	26
3.2 Jenis Penelitian	26
3.3 Variabel Penelitian.....	26
3.4 Metode Pengumpulan Data	27
3.5 Teknik Pengambilan Sampel.....	29
3.6 Teknik Analisis Data.....	29
BAB IV	31
ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....	31
4.2 Uji Normalitas	32
4.3 Analisis dan Pembahasan	33
4.3.1 Analisis Data Dampak Perang Dagang terhadap IHSG	33
4.3.3 Analisis Data Dampak Perang Dagang terhadap Sektor <i>Mining</i>	45
4.3.4 <i>Summary</i> Pembahasan Dampak Perang Dagang terhadap Sektor <i>Mining</i>.....	57
BAB V.....	59
SIMPULAN DAN SARAN.....	59
5.1 Simpulan.....	59
5.2 Saran.....	60
DAFTAR PUSTAKA.....	62
LAMPIRAN	66

Daftar Gambar

Gambar 1.1 IHSB <i>Trendline</i>	2
Gambar 4.1 Grafik Histogram IHSB Event 1.....	32
Gambar 4.2 IHSB <i>Trendline</i>	36
Gambar 4.3 Return IHSB <i>Event 1</i>	37
Gambar 4.4 Return IHSB <i>Event 2</i>	39
Gambar 4.5 Return IHSB <i>Event 3</i>	42
Gambar 4.6 <i>Mining Sector Trendline</i>	46
Gambar 4.7 WTI <i>Oil Price 2018</i>	47
Gambar 4.8 <i>Abnormal Return Sektor Mining Event 1</i>	49
Gambar 4.9 <i>Abnormal Return Sektor Mining dan Perusahaan Event 1</i>	49
Gambar 4.10 <i>Abnormal Return Sektor Mining Event 2</i>	51
Gambar 4.11 <i>Abnormal Return Sektor Mining dan Perusahaan Event 2</i>	52
Gambar 4.12 <i>Abnormal Return Sektor Mining Event 3</i>	54
Gambar 4.13 <i>Abnormal Return Sektor Mining dan Perusahaan Event 3</i>	55

Daftar Tabel

Tabel 1.1 <i>Event</i> Perang Dagang.....	3
Tabel 3.1 Pembagian <i>Estimation Window</i> dan <i>Event Window</i>	28
Tabel 3.2 Langkah Analisis	28
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif <i>Event</i> 1	31
Tabel 4.2 Hasil Uji Normalitas IHSG <i>Event</i> 1.....	32
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas <i>Mining Event</i> 1	33
Tabel 4.4 Nilai Z-Score IHSG <i>Event</i> 1	38
Tabel 4.5 Hasil Uji Signifikansi IHSG <i>Event</i> 1	39
Tabel 4.6 Nilai Z-Score IHSG <i>Event</i> 2	41
Tabel 4.7 Hasil Uji Signifikansi IHSG <i>Event</i> 2	41
Tabel 4.8 Nilai Z-Score IHSG <i>Event</i> 3	43
Tabel 4.9 Hasil Uji Signifikansi IHSG <i>Event</i> 3	43
Tabel 4.10 Nilai Z-Score <i>Mining Event</i> 1.....	50
Tabel 4.11 Hasil Uji Signifikansi Sektor <i>Mining Event</i> 1	50
Tabel 4.12 Nilai Z-Score <i>Mining Event</i> 2.....	51
Tabel 4.13 Hasil Uji Signifikansi Sektor <i>Mining Event</i> 2	53
Tabel 4.14 Nilai Z-Score <i>Mining Event</i> 3.....	56
Tabel 4.15 Hasil Uji Signifikansi Sektor <i>Mining Event</i> 3	56

Daftar Lampiran

Lampiran 1: Statistik Deskriptif.....	66
Lampiran 2: Hasil Uji Normalitas.....	66
Lampiran 3: Perbandingan Nilai Volatilitas IHSG.....	67
Lampiran 4: Perbandingan Nilai Volatilitas Indeks Sektor Mining	67