

DAFTAR ISI

PERNYATAAN ORISINALITAS DAN BEBAS PLAGIAT	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
KATA PENGANTAR	iii
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR SINGKATAN DAN ISTILAH	x
Bab 1	1
Pendahuluan	1
I.1. Latar Belakang.....	1
I.2. Identifikasi Masalah	7
I.3. Rumusan Penelitian	8
I.4. Tujuan Penelitian.....	8
I.5. Manfaat Penelitian.....	8
I.6. Sistematika Penulisan Penelitian	9
Bab II.....	10
Kajian Literatur	10
II.1. Tren dan Dampak Investasi Indonesia 2020.....	10
II.2. Definisi Efisiensi Pasar.....	11
II.3. Hipotesis Pasar Efisien	12
II.4. Abnormal Return	15
II.5. Indeks Sharpe (Risk-Adjusted Return).....	17
II.6. Strategi Investasi Momentum.....	17

II.7.	Return Saham Farmasi saat pandemi COVID-19.....	19
II.8.	Penelitian Strategi Investasi Momentum Terdahulu.....	20
II.9.	Kerangka Konseptual & Hipotesis Penelitian	21
II.9.1.	Kerangka Konseptual	21
II.9.2.	Hipotesis Penelitian.....	21
Bab III	22
Metode Penelitian.....		22
III.1.	Desain Penelitian	22
III.2.	Variabel & Definisi Operasional Variabel	23
III.2.1.	Abnormal return portofolio.....	23
III.2.2.	Average Abnormal Return Portofolio.....	24
III.2.3.	Cumulative Abnormal Return.....	24
III.2.4.	Cumulative abnormal return portofolio	24
III.2.5.	Sharpe Portofolio.....	24
III.2.6.	Statistik Uji beda dua rata-rata.....	25
III.3.	Metode Analisis Data	25
Bab IV	27
Hasil Pengujian dan Pembahasan.....		27
IV.1.	Linear Regresi	27
IV.2.	Pembentukan Portofolio Saham	27
IV.3.	Pengujian Indeks Sharpe	29
IV.4.	Uji Hasil Beda Dua Rata-Rata.....	30
Bab V	32
Kesimpulan dan Saran.....		32
V.I.	Kesimpulan.....	32
V.II.	Saran	32
DAFTAR PUSTAKA		33