

## **BAB III**

### **METODE PENELITIAN**

#### **3.1. Jenis Penelitian**

Melihat dari berdasarkan jenis dan analisis datanya, penelitian ini termasuk kedalam penelitian kuantitatif. Metode penelitian kuantitatif adalah cara untuk memperoleh ilmu atau cara memecahkan masalah secara hati-hati dan sistematis dengan data-data yang dikumpulkan berupa rangkainan serta kumpulan angka-angka (Nasehudin dan Gozali 2012).

Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah studi peristiwa (*event study*). Studi peristiwa atau *event study* sendiri dibidang pasar modal merupakan suatu pelajaran yang digunakan secara empiris dengan tujuan menganalisis dampak yang terjadi dari suatu peristiwa terhadap pasar modal suatu wilayah otonom ekonomi khususnya dalam bentuk negara. Dengan kata lain, studi ini dilakukan untuk menginvestigasi reaksi pasar modal terhadap suatu peristiwa (Renald Suganda 2018).

#### **3.2. Waktu dan Tempat Penelitian**

##### **1. Waktu Penelitian**

Proses pelaksanaan penelitian ini akan dilakukan setelah disahkannya proposal ini pada tanggal 25 Mei 2023.

##### **2. Tempat Penelitian**

Penelitian ini dilaksanakan di Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam Institut Agama Islam Negeri Kendari.

### 3.3. Populasi dan Sampel

#### 1. Populasi

Populasi yang digunakan dalam menentukan jumlah sampel pada penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang termaksud kedalam perusahaan manufaktur sektor industri sub sektor otomotif dan komponen yang telah terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada setiap priode tahun penelitian yaitu 2014,2015,2018, dan 2022.

#### 2. Sampel

Sampel adalah bagian dari jumlah dan karakteristik yang dimiliki oleh populasi tersebut. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang termaksud kedalam perusahaan otomotif dan komponen di Bursa Efek Indonesia (BEI). Indeks perusahaan otomotif dan komponen dipilih karena peneliti Penentuan sampel ditentukan berdasarkan kriteria pertimbangan tertentu antara lain:

1. Perusahaan tersebut telah terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada priode penelitian.
2. Perusahaan yang terdaftar sebagai perusahaan otomotif dan komponen sahamnya diperdagangkan setiap hari selama priode penelitian.
3. Perusahaan yang terdaftar sebagai perusahaan otomotif dan komponen tidak melakukan *corporate action* lain, seperti *right issue*, *stock split*, pembagian diveden dan

pembagian saham bonus. Karena peneliti ingin memfokuskan penelitian pada peristiwa kenaikan harga BBM.

Adapun perusahaan sampel yang digunakan dalam penelitian ini setiap periode tahun peristiwa kenaikan harga BBM memiliki perbedaan jumlah perusahaan sampel. Pada tahun 2014 dan 2015 sampel perusahaan yang digunakan sebanyak 10 perusahaan, pada tahun 2018 sebanyak 14 perusahaan, dan pada tahun 2022 sebanyak 15 perusahaan sampel. Hal ini dikarenakan setiap periode perusahaan yang termaksud kedalam sektor otomotif dan komponen terus mengalami perubahan dengan semakin bertambahnya jenis perusahaan tersebut yang terdaftar di bursa efek Indonesia.

### **3.4. Teknik Pengumpulan Data**

Metode data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder, sehingga teknik pengumpulan data dilakukan dengan cara :

1. Memperoleh data dan informasi yang diperlukan dalam penelitian yang akan dilakukan dengan cara mengakses internet pada website bursa efek indonesia yaitu [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id), dan yahoo finance.
2. Mengutip langsung dari sumber tertulis seperti jurnal-jurnal, serta buku-buku ekonomi dari sumber terpercaya.

### 3.5. Instrumen Penelitian

Instrumen penelitian merupakan alat atau fasilitas yang sering digunakan oleh peneliti untuk mengumpulkan data penelitian agar pekerjaannya menjadi lebih efisien dan mudah, dalam arti lebih cermat, lengkap dan sistematis sehingga lebih mudah untuk diolah. instrumen yang digunakan dalam penelitian adalah data sekunder yang diperoleh dari web Bursa Efek Indonesia dan yahoo finance.

### 3.6. Teknik Analisis Data

Pada penelitian ini metode yang digunakan adalah analisis *event study* atau studi peristiwa yaitu melihat bagaimana kandungan informasi dapat mempengaruhi reaksi pasar yang banyak dipakai dalam penelitian-penelitian terdahulu, antara lain yaitu oleh Eka Aries Fansuri (2017) dan Diah Andriani (2015). Langkah awal yang dilakukan dalam penelitian ini adalah dengan menentukan periode rentan waktu penelitian. Periode waktu penelitian yang digunakan adalah harga saham harian jumlah saham harian yang beredar selama 71 hari bursa yang terdiri dari dua periode yaitu periode estimasi (*estimation period*) dan periode peristiwa (*event period*).

Penelitian ini menggunakan Uji asumsi klasik akan tetapi pengujiannya hanya dilakukan dengan salah satu uji asumsi klasik yaitu uji normalitas saja karena penelitian ini merupakan penelitian *event study* dimana variabel independenya berupa peristiwa sehingga tidak bisa diuji yang dengan ketiga uji asumsi klasik lainnya, seperti uji multikolinearitas, uji autokorelasi, dan uji heterokedastisitas tidak

digunakan pada penelitian ini karena memerlukan data untuk setiap variabel baik itu variabel dependen maupun independen.

Tujuan uji normalitas adalah guna untuk mengetahui apakah dalam model statistik, variabel pengganggu atau residual mempunyai distribusi normal atau tidak (Ghozali, 2013). Untuk mendeteksi normalitas data dapat dilakukan pula melalui analisis statistik yang salah satunya dapat dilihat melalui *Kolmogorov-Smirnov test* (K-S). Dasar pengambilan keputusan dalam uji K-S adalah sebagai berikut:

1. Apabila angka hasil pengujian uji *kolmogorov smirnov* lebih kecil dari  $\text{Sig} < 0,05$  maka dapat dikatakan bahwa distribusi data tidak normal.
2. Jika angka hasil pengujian uji *kolmogorov smirnov* lebih besar dari  $\text{Sig} > 0,05$  maka dapat dikatakan bahwa distribusi data normal.

Apabila terjadi hasil pengujian data menunjukkan data terdistribusi dengan normal, maka penelitian dilanjutkan dengan melakukan pengujian *paired sample t-test*. Tetapi jika dari hasil pengujian menunjukkan bahwa data tidak terdistribusi dengan normal, maka akan menggunakan Uji nonparametric yakni uji Wilcoxon (*Wilcoxon Signed Rank Test*). (Ramadhani rizka, 2015).