

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK	x
ABSTRACT	xi
اللمخص.....	xii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	xiii
DAFTAR ISI	xv
DAFTAR TABEL	xviii
DAFTAR GAMBAR	xix
DAFTAR LAMPIRAN	xx
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	16
1.3 Tujuan Penelitian.....	17
1.4 Manfaat Penelitian.....	17
1.5 Sistematika Penulisan.....	18
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	20
2.1 Landasan Teori.....	20
2.1.1 Investasi.....	20
2.1.1.1 Investasi dalam Pandangan Islam	21
2.1.2 Pasar Modal.....	23
2.1.2.1 Pasar Modal Syariah.....	24
2.1.2.2 Pasar Modal di Indonesia	26

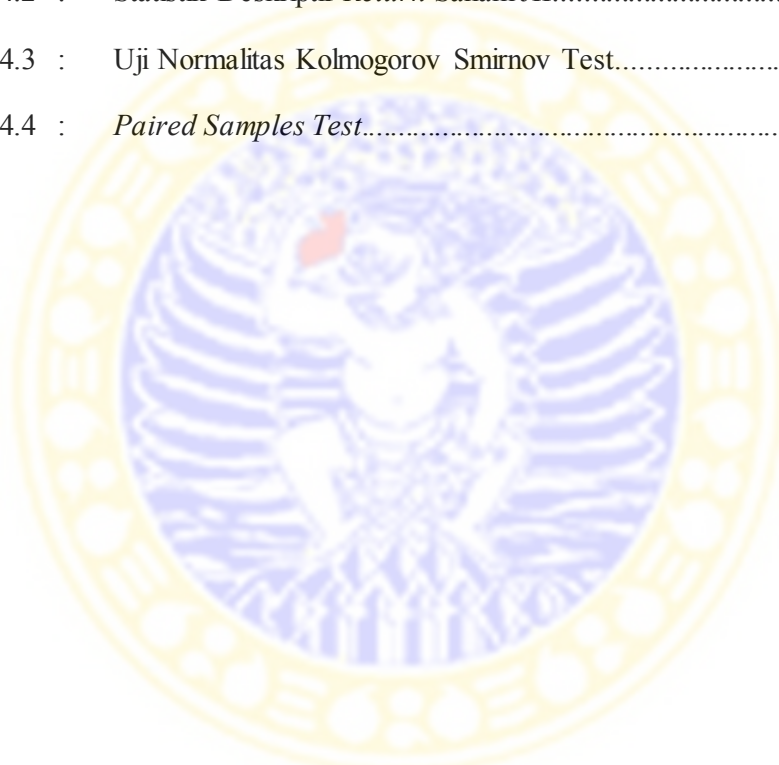
2.1.3 Bursa Efek dan Indeks Saham.....	27
2.1.4 Saham dan Saham Syariah.....	29
2.1.4.1 Dasar Hukum Jual Beli Efek Menurut Islam.....	30
2.1.4.2 <i>Return</i> Saham.....	32
2.1.5 Efisiensi Pasar.....	35
2.1.6 <i>Signalling Theory</i>	39
2.1.7 Anomali Pasar.....	40
2.1.7.1 <i>Monday Effect</i>	41
2.2 Penelitian Sebelumnya.....	42
2.3 Hipotesis.....	45
2.4 Model Analisis.....	45
2.5 <i>Event Study</i>	46
2.6 Kerangka Berpikir.....	46
BAB 3 METODE PENELITIAN.....	48
3.1 Pendekatan Penelitian.....	45
3.2 Identifikasi Variabel.....	49
3.3 Definisi Operasional Variabel.....	49
3.3.1 Peristiwa <i>Monday Effect</i>	49
3.3.2 <i>Return</i> Saham.....	49
3.4 Populasi dan Sampel.....	50
3.5 Pengumpulan Data.....	51
3.6 Jenis Data dan Sumber Data.....	51
3.7 Teknik Analisis Data.....	52
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN.....	55
4.1 Gambaran Umum Emiten Yang Terdaftar di JII.....	55
4.2 Deskripsi Hasil Penelitian.....	58
4.2.1 Peristiwa <i>Monday Effect</i>	58

4.2.2 Statistik Deskriptif <i>Return</i> Saham.....	60
4.2.3 Uji Normalitas Data	64
4.3 Analisis Model dan Pengujian Hipotesis pada Pengamatan Harian	65
4.4 Pembahasan.....	66
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN	70
5.1 Simpulan.....	70
5.2 Saran.....	70
DAFTAR PUSTAKA	72



DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 : Indeks Pasar JII Bulan Februari 2014.....	13
Tabel 2.1 : Daftar Saham yang Masuk Penghitungan JII Periode Desember 2013-Mei 2014.....	28
Tabel 4.1 : <i>Return</i> Saham Harian JII.....	59
Tabel 4.2 : Statistik Deskriptif <i>Return</i> Saham JII.....	61
Tabel 4.3 : Uji Normalitas Kolmogorov Smirnov Test.....	64
Tabel 4.4 : <i>Paired Samples Test</i>	65



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1 : Pergerakan <i>Return</i> Saham JII Februari 2014.....	15
Gambar 1.2 : Pergerakan Indeks Pasar JII.....	16
Gambar 2.1 : Efisiensi Pasar Berdasarkan Informasi.....	37
Gambar 2.2 : <i>Event Window</i> Penelitian.....	46
Gambar 2.3 : Kerangka Berpikir.....	47
Gambar 4.1 : <i>Return</i> Saham Harian JII.....	59
Gambar 4.2 : Rata-rata <i>Return</i> Saham.....	66

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran I : Daftar Saham Masuk Penghitungan JII.....	75
Lampiran II : Rata-rata <i>Return</i> Saham Masuk Penghitungan JII.....	76
Lampiran III : Uji Normalitas Data Kolmogorov-Smirnov.....	77
Lampiran IV : Hasil <i>Uji Paired Sample T-Test</i>	78

