

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
<i>DECLARATION</i>	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	viii
<i>ABSTRACT</i>	ix
.....	x
PEDOMAN TRANSLITERASI.....	xi
DAFTAR ISI	xiv
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR GAMBAR	xvii
DAFTAR PERSAMAAN	xviii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xix
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	9
1.5 Sistematika Penulisan	10
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Landasan Pustaka	12
2.1.1 Landasan Syariah dalam Bermuamalah.....	12
2.1.2 Investasi	14
2.1.2.1 Pengertian Investasi	14
2.1.2.2 Investasi Syariah	16
2.1.3 Pasar Modal	18
2.1.3.1 Pengertian Pasar Modal	18
2.1.3.2 Pasar Modal Syariah	19
2.1.3.3 Pasar Modal Efisien	20
2.1.3.4 Bentuk-bentuk Pasar Modal Efisien	22
2.1.4 Saham.....	25
2.1.4.1 Pengertian Saham.....	25
2.1.4.2 Saham Syariah	26
2.1.4.3 Harga Saham	27
2.1.4.4 Faktor-faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham.....	28
2.1.4.5 Return Saham.....	29
2.1.5 Peraturan Pemerintah Nomor 1 Tahun 2014	32
2.1.6 <i>Abnormal Return</i>	32
2.1.7 <i>Trading Volume Activity</i>	34
2.1.8 Dampak Informasi Tentang Pengumuman PP Nomor 1 Tahun 2014	

	Pada <i>Abnormal Return</i>	35
2.1.9	Dampak Informasi Tentang Pengumuman PP Nomor 1 Tahun 2014 Pada <i>Trading Volume Activity</i>	36
2.1.10	<i>Event Study</i>	37
2.2	Penelitian Sebelumnya	38
2.3	Hipotesis	40
2.4	Model Analisis	40
2.5	Kerangka Berpikir	42
BAB 3 METODE PENELITIAN		
3.1	Jenis dan Pendekatan Penelitian	43
3.2	Identifikasi Variabel	44
3.3	Definisi Operasional Variabel	44
3.4	Jenis dan Sumber Data	46
3.5	Populasi	46
3.6	Prosedur Penentuan Sampel	47
3.7	Prosedur Pengumpulan Data	47
3.8	Teknik Analisis Data	48
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN		
4.1	Gambaran Umum Subjek Penelitian	56
4.2	Deskripsi Hasil Penelitian	58
4.2.1	Analisis Statistik Deskriptif	58
4.2.2	Statistik Deskriptif Terhadap <i>Abnormal Return</i>	58
4.2.3	Statistik Deskriptif Terhadap <i>Trading Volume Activity</i>	65
4.3	Analisis Hasil Penelitian	67
4.3.1	Uji Normalitas	67
4.3.2	Uji Hipotesis	69
4.3.2.1	Analisis Uji Hipotesis <i>Average Abnormal Return</i>	69
4.3.2.2	Analisis Uji Hipotesis <i>Average Trading Volume Activity</i>	70
4.4	Pembahasan	71
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Simpulan	79
5.2	Saran	80
	DAFTAR PUSTAKA	82

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Kapitalisasi Pasar Modal Indonesia Agustus 2013 – Desember 2013	1
Tabel 2.1 Penelitian Sebelumnya	39
Tabel 4.1 Subjek Penelitian	57
Tabel 4.2 Persamaan Regresi Model Ekspektasi	59
Tabel 4.3 Tabel <i>Average Actual Return</i> , <i>Average Expected</i> , dan <i>Average Abnormal Return (AAR)</i> Emiten Selama Periode Pengamatan	60
Tabel 4.4 Tabel <i>Average Abnormal Return (AAR)</i> Seluruh Emiten Selama Periode Pengamatan	64
Tabel 4.5 Tabel <i>Average Trading Volume Activity (ATVA)</i> Emiten Selama Periode Pengamatan	65
Tabel 4.6 Tabel <i>Average Trading Volume Activity (ATVA)</i> Seluruh Emiten Selama Periode Pengamatan.....	67
Tabel 4.7 Hasil Uji Normalitas <i>One Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i>	68
Tabel 4.8 Tabel Hasil Uji Statistik <i>Paired Samples T-Test</i> Pada <i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	69
Tabel 4.9 Tabel Hasil Uji Statistik <i>Paired Samples T-Test</i> Pada <i>Average Trading Volume Activity (ATVA)</i>	70

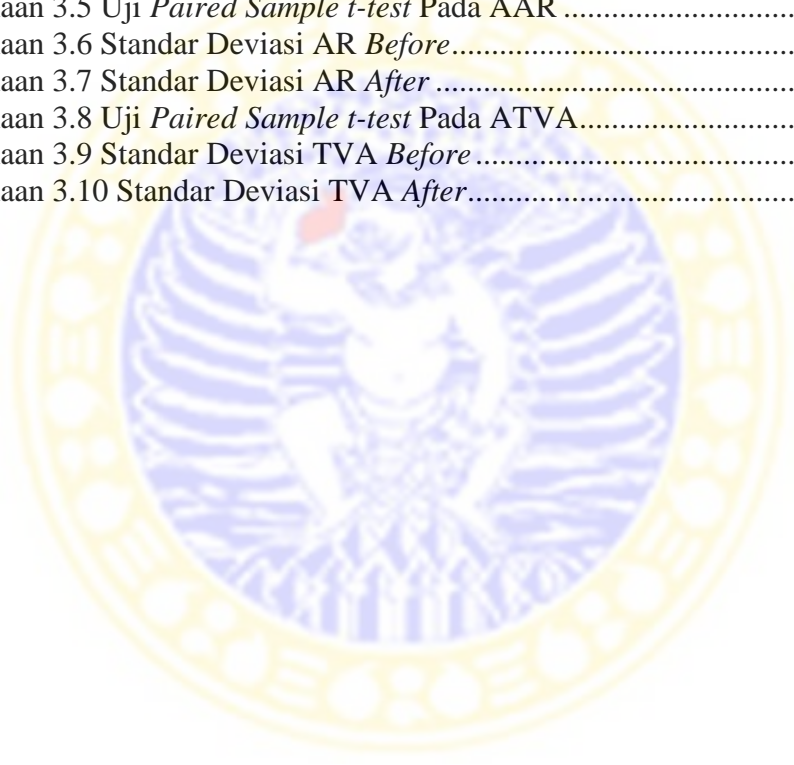
DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Model Analisis	41
Gambar 2.2 Kerangka Berpikir	42
Gambar 3.1 <i>Event Window</i> Yang Digunakan Dalam Penelitian	49
Gambar 4.1 Grafik <i>Average Abnormal Return (AAR)</i> Seluruh Emiten Selama Periode Pengamatan	72
Gambar 4.2 Grafik <i>Average Trading Volume Activity (ATVA)</i> Seluruh Emiten Selama Periode Pengamatan.....	75



DAFTAR PERSAMAAN

Persamaan 2.1 <i>Actual Return</i>	30
Persamaan 2.2 <i>Expected Return Mean Adjusted Model</i>	30
Persamaan 2.3 <i>Expected Return Market Adjusted Model</i>	31
Persamaan 2.4 <i>Expected Return Market Model</i>	31
Persamaan 2.5 <i>Abnormal Return</i>	33
Persamaan 2.6 <i>Trading Volume Activity</i>	35
Persamaan 3.1 <i>Average Abnormal Return (AAR) Before</i>	45
Persamaan 3.2 <i>Average Abnormal Return (AAR) After</i>	45
Persamaan 3.3 <i>Average Trading Volume Activity (ATVA) Before</i>	45
Persamaan 3.4 <i>Average Trading Volume Activity (ATVA) After</i>	45
Persamaan 3.5 Uji <i>Paired Sample t-test</i> Pada AAR	53
Persamaan 3.6 Standar Deviasi AR <i>Before</i>	53
Persamaan 3.7 Standar Deviasi AR <i>After</i>	53
Persamaan 3.8 Uji <i>Paired Sample t-test</i> Pada ATVA	54
Persamaan 3.9 Standar Deviasi TVA <i>Before</i>	54
Persamaan 3.10 Standar Deviasi TVA <i>After</i>	55



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 <i>Actual Return Estimation Period</i>	86
Lampiran 2 Hasil <i>Output</i> Regresi Model Estimasi <i>Expected Return</i>	91
Lampiran 3 <i>Actual Return Window Period</i>	97
Lampiran 4 <i>Expected Return Window Period</i>	99
Lampiran 5 <i>Abnormal Return Window Period</i>	101
Lampiran 6 Jumlah Saham Yang Diperdagangkan.....	103
Lampiran 7 Jumlah Saham Yang Tercatat Di Bursa.....	105
Lampiran 8 <i>Trading Volume Activity Window Period</i>	107
Lampiran 9 <i>Output</i> SPSS Uji Normalitas <i>One Sample Kolmogorov-Smirnov</i> ..	109
Lampiran 10 <i>Output</i> SPSS Uji Hipotesis <i>Paired Samples T-Test</i>	111
Lampiran 11 PP Nomor 1 Tahun 2014	113

