

DAFTAR ISI

HALAMAN PERSETUJUAN.....	i
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	ii
DECLARATION	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK.....	viii
ABSTRACT.....	ix
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN.....	xi
DAFTAR ISI.....	xiv
DAFTAR TABEL.....	xviii
DAFTAR GAMBAR	xix
DAFTAR PERSAMAAN	xx
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan Penelitian	12
1.4 Manfaat Penelitian	13
1.5 Sistematika Penulisan	13

BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	15
2.1 Landasan Teori.....	15
2.1.1 Muamalah dalam Perspektif Islam.....	15
2.1.2 Investasi	19
2.1.2.1 Investasi dalam Islam.....	21
2.1.3 Pasar Modal.....	24
2.1.3.1 Pasar Modal Syariah.....	26
2.1.4 Saham.....	28
2.1.4.1 Saham Syariah.....	29
2.1.4.2 Return Saham.....	30
2.1.4.3 Harga Saham.....	33
2.1.5 Efisiensi Pasar Modal.....	35
2.1.5.1 Teori Pasar efisien.....	36
2.1.5.2 Bentuk Pasar Efisien.....	38
2.1.6 <i>Event Study</i>	39
2.1.7 Reaksi Pasar	42
2.1.7.1 <i>Abnormal Return</i>	44
2.1.7.2 <i>Trading Volume Activity</i>	46
2.1.8 Corporate Action.....	47
2.1.9 Dividen.....	48
2.1.9.1 Kebijakan Dividen	50

2.1.9.2 <i>Cash dividend</i>	53
2.1.10 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	56
2.2 Penelitian Terdahulu	57
2.3 Hipotesis dan model Analisis.....	59
2.3.1 Hipotesis.....	59
2.3.2 Model Analisis.....	60
2.4 Kerangka Berfikir.....	61
BAB 3 METODE PENELITIAN	61
3.1 Pendekatan Penelitian	62
3.2 Identifikasi Variabel.....	63
3.3 Definisi Operasional.....	63
3.4 Jenis Dan Sumber Data	64
3.5 Populasi dan Sampel	65
3.6 Prosedur Pengumpulan Data	66
3.7 Teknik Analisis	67
BAB 4 PEMBAHASAN	71
4.1 Gambaran Umum Mengenai Subjek dan Objek Penelitian	71
4.1.1 Gambaran Umum <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	71
4.1.2 Gambaran Umum Objek Penelitian	73
4.2 Deskripsi Hasil Penelitian	73

4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif	73
4.2.2 Statistik Deskriptif Average Abnormal Return.....	75
4.2.3 Statistik Deskriptif Trading Volume Activity.....	80
4.3 Analisis Model dan Pengujian Hipotesis	83
4.3.1 Uji Normalitas Pada Average Abnormal Return	83
4.3.2 Analisis Average Abnormal Return dengan Wilcoxon Signed Rank Test.....	84
4.3.3 Uji Normalitas Pada Trading Volume Activity	85
4.3.4 Analisis Trading Volume Activity dengan Uji <i>Paired T Test</i>	86
4.4 Pembahasan.....	87
4.4.1 Hasil dan Pembahasan <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman.....	89
4.4.2. Hasil dan Pembahasan <i>Trading Volume Activity</i> sebelum dan sesudah pengumuman	91
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN	93
5.1 Simpulan	93
5.2 Saran.....	93
DAFTAR PUSTAKA	95