

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBINNG SKRIPSI	ii
PENGESAHAN SKRIPSI.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
MOTTO.....	vi
PERSEMBAHAN	vii
TRANSLITERASI ARAB LATIN	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian.....	6
D. Manfaat Penelitian.....	7
E. Sistematika Penelitian	7
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori.....	9
1. Teori Efisiensi Pasar Modal	9
2. <i>Return Abnormal</i>	10
3. <i>Signalling Theory</i>	11
4. <i>Trading Volume Activity</i>	12
5. <i>Expected Return</i>	12
6. Return Saham.....	12
7. Pasar Modal Syariah	12
8. Indeks Saham Syariah.....	16
9. Informasi dalam Integrasi Islam.....	18
10. Peristiwa Kenaikan Harga BBM 3 September 2022.....	20
B. Penelitian Terdahulu	20
C. Kerangka Berfikir.....	24
D. Hipotesis.....	24
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian.....	27
B. Jenis dan Sumber Data	28
C. Setting Penelitian.....	28
D. Populasi dan Sampel	29
E. Desain dan Definisi Operasional Variabel	31
F. Teknik Pengolahan Data	31

G. Metode Analisis Data	32
1. Statistik Deskriptif	32
2. Uji Normalitas	33
3. Pengujian Hipotesis.....	33
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian	35
1. Gambaran Obyek Penelitian	35
2. Deskripsi Data Penelitian.....	35
B. Analisis Data Penelitian	51
a. Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	51
b. Uji Normalitas Avarage Trading Volume Activity	52
c. Uji Hipotesis Average Abnormal Return	52
d. Uji Hipotesis Average Trading Volume Activity	53
C. Pembahasan.....	55
1. Perbedaan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan Harga BBM.....	55
2. Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan Harga BBM.	56
BAB V PENUTUP	
A. Simpulan	58
B. Saran.....	58
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1. 1. <i>Research Gap</i>	5
Tabel 2. 1. Penelitian Terdahulu dan Gap Penelitian	21
Tabel 2. 2. Kerangka Berfikir.....	24
Tabel 3. 1 Saham JII Tiap Sektor	29
Tabel 3. 2. Saham Persektor.....	31
Tabel 4. 1. <i>Abnormal Return</i> Sebelum Peristiwa Kenaikan BBM	36
Tabel 4. 2. <i>Abnormal Return</i> Sesudah Peristiwa Kenaikan BBM.....	37
Tabel 4. 3. <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Peristiwa	38
Tabel 4. 4. <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	39
Tabel 4. 5. Deskriptif Statistik <i>Average Abnormal Return</i>	40
Tabel 4. 6. Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	41
Tabel 4. 7. <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum Peristiwa Kenaikan BBM.....	44
Tabel 4. 8. <i>Trading Volume Activity</i> Sesudah Peristiwa Kenaikan BBM.....	45
Tabel 4. 9. <i>Avarage Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Peristiwa.....	46
Tabel 4. 10. <i>Avarage Trading Volume Activity</i> Sebelum Sesudah Kenaikan BBM.....	47
Tabel 4. 11. Deskriptif Statistik <i>Trading Volume Activity</i>	48
Tabel 4. 12. Statistik Dekriptif <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum Dan Sesudah Kenaikan BBM.....	49
Tabel 4. 13. Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	51
Tabel 4. 14. Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	52
Tabel 4. 15. Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Abnormal Return</i>	53
Tabel 4.16. Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Trading Volume Activity</i>	54
Tabel 4. 17. Hasil Penelitian.....	54

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1. Harga BBM Per 3 September 2022	3
Gambar 3. 1. Periode Waktu	29
Gambar 4. 1. Pergerakan <i>Average Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM.....	40
Gambar 4.2. Pergerakan <i>Average Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Kenaikan BBM	47

