

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN.....	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN.....	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori	11
1. Teori Sinyal (Signalling Theory).....	11
2. Hipotesis Pasar Efisien (Efficient Market Hypothesis)	13
3. Pasar Efisien.....	15
4. Studi Peristiwa (Event Study).....	16
5. Dividen	18
6. Abnormal Return.....	22
7. Trading Volume Activity (TVA)	23
8. Pasar Modal.....	25
9. Pasar Modal Syariah	26
10. Saham.....	30
B. Penelitian Terdahulu.....	32
C. Kerangka Berfikir.....	37
D. Hipotesis.....	38

BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan	40
B. Sumber Data.....	40
C. Populasi dan Sampel.....	41
D. Identifikasi Variabel	44
E. Definisi Operasioanal dan Pengukuran Variabel ..	45
F. Teknik Pengumpulan Data.....	45
G. Teknik Pengolahan Data	46
H. Teknik Analisis Data	49
BAB IV HASIL PENELITIAN PEMBAHASAN	
A. Gambaran Obyek Penelitian	52
B. Pengujian Data.....	56
C. Analisis Data.....	59
D. Pembahasan.....	61
BAB V PENUTUP	
A. Simpulan	66
B. Saran	66
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 penelitian terdahulu	32
Table 3.1 Research populasi.....	41
Table 3.2 Hasil Sampel Penelitian	43
Table 3.3 Research Sampel	44
Tabel 3.4 Definisi Operasional Variabel	45
Tabel 4.1 Hasil Uji Deskriptif Abnormal Return Sebelum dan Sesudah Ex-Dividend Date.....	57
Tabel 4.2 Hasil Uji Deskriptif TVA Sebelum dan Sesudah Ex- Dividend Date	57
Tabel 4.3 Hasil Uji Statistik Deskriptif Abnormal Return Sebelum dan Setelah Ex-Dividend Date.....	58
Tabel 4.4 Hasil Uji Statistik Deskriptif Trading Volume Activity Sebelum dan Setelah Ex-Dividend Date	59
Tabel 4.5 Hasil Uji Paired sample T-test.....	60
Tabel 4.6 Hasil Uji Wilcoxon	61

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Tahun 2020-2022	3
Gambar 2.1 Kerangka Berfikir	37
Gambar 3.5 Window Period	46

