

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN NOTA PEMBIMBING	ii
HALAMAN NOTA PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
ABSTRAK	v
HALAMAN MOTTO	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
BAB I : PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	7
E. Sistematika Penulisan Skripsi	8
BAB II : LANDASAN TEORI	10
A. Efficient Market Hypothesis	10
1. Pengertian Efficient Market Hypothesis	10
2. Alasan Pasar Efisien dan Tidak Efisien .	12
3. Bentuk-bentuk Pasar Efisien.....	13
4. Pengujian Hipotesis Pasar Efisien	17
5. Pentingnya Pasar Efisien	20
B. Event Study Theory	22
C. Pasar Modal Syariah	24
1. Pengertian Pasar Modal Syariah	24
2. Instrumen Modal Syariah.....	27
3. Akad-akad Pasar Modal Syariah.....	37
4. Jenis Indeks Harga Saham	38
5. Fungsi Pasar Modal	44
D. January Effect	45
1. Pengertian January Effect	45
2. Faktor-faktor Terjadinya January Effect	46
E. Return Saham.....	48

1. Pengertian Return Saham	48
2. Komponen Return.....	49
3. Pengukuran Return	50
F. Penelitian Terdahulu	51
G. Kerangka Pemikiran.....	57
H. Hipotesis	58
BAB III : METODE PENELITIAN.....	61
A. Jenis Penelitian.....	61
B. Jenis dan Sumber Data.....	61
C. Populasi dan Sampel	62
D. Tata Variabel Penelitian.....	65
E. Definisi Operasional Variabel.....	66
F. Periode Pengamatan.....	67
G. Metode Analisis Data.....	68
1. Statistik Deskriptif	68
2. Uji Normalitas.....	69
3. Uji Hipotesis	70
BAB IV : HASIL PENELITIAN	72
A. Deskripsi Data.....	72
B. Analisis Data.....	86
1. Uji Normalitas.....	86
2. Uji Hipotesis	79
C. Pembahasan.....	91
1. Pengujian <i>Return</i> Saham Sebelum dan Setelah <i>January Effect</i> Pada Kelompok Saham di JII	91
2. Pengujian <i>Return</i> Saham Sebelum dan Setelah <i>January Effect</i> Pada perusahaan Industri Penghasil Bahan Baku, Perusahaan Manufaktur dan Perusahaan Jasa yang Terdaftar di JII.....	94
BAB V : PENUTUP.....	100
A. Kesimpulan	100
B. Keterbatasan Penelitian	101
C. Implikasi Penelitian.....	101
D. Saran.....	101
E. Penutup.....	102

**DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN-LAMPIRAN
RIWAYAT HIDUP PENULIS**



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Perbedaan Sukuk dan Obligasi	33
Tabel 2.2	Penelitian Terdahulu	51
Tabel 3.1	Daftar Saham Sektor Utama (Industri Penghasil Bahan Baku).....	64
Tabel 3.2	Daftar Saham Sektor kedua (Manufaktur).....	64
Tabel 3.3	Daftar Saham Sektor Ketiga (Jasa).....	65
Tabel 3.4	Definisi Operasional	66
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif Return Saham Di JII	73
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif Return Saham Periode Pengamatan Limabelas Hari	74
Tabel 4.3	Return Tertinggi dan Terendah di JII Periode Pengamatan Limabelas Hari	80
Tabel 4.4	Statistik Deskriptif Return Saham Perusahaan Industri Penghasil Bahan Baku.....	83
Tabel 4.5	Statistik Deskriptif Return Saham Perusahaan Manufaktur	84
Tabel 4.6	Statistik Deskriptif Return Saham Perusahaan Jasa.....	85
Tabel 4.7	Uji Normalitas	86
Tabel 4.8	Hasil Uji Paired Sample T-test Return Saham Di JII	88
Tabel 4.9	Hasil Uji Paired Sample T-test Return Saham Perusahaan Industri Penghasil Bahan Baku.....	89
Tabel 4.10	Hasil Uji Paired Sample T-test Return Saham Perusahaan Manufaktur	90
Tabel 4.11	Hasil Uji Paired Sample T-test Return Saham Perusahaan Jasa	90
Tabel 4.12	Ringkasan Hasil Uji Paired Sample T-test Return Saham Perusahaan Industri Penghasil Bahan Baku, Perusahaan Manufaktur dan Perusahaan Jasa	94
Tabel 4.13	Ringkasan Hasil Uji Statistik Deskriptif Return Saham Sektor Industri Penghasil Bahan Baku, Manufaktur dan Jasa Periode Sebelum dan Setelah.....	99

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Paradigma Penelitian	57
Gambar 3.1 Periode Pengamatan	64
Gambar 4.1 Return Saham Di JII Limabelas Hari Pengamatan	81

