

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL i

PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI ii

HALAMAN PENGESAHAN iii

LEMBAR PERNYATAAN iv

ABSTRAK..... v

MOTTO vi

PERSEMBAHAN vii

PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN..... ix

KATA PENGANTAR..... x

DAFTAR ISI xii

DAFTAR TABEL xiv

DAFTAR GAMBAR xv

BAB I PENDAHULUAN

 A. Latar Belakang Masalah 1

 B. Rumusan Masalah 9

 C. Tujuan Penelitian 10

 D. Manfaat Penelitian 10

 E. Sistematika Penulisan 11

BAB II LANDASAN TEORI

 A. Deskripsi Teori 13

 1. *Grand Teory* 13

 2. Pasar Modal 13

 3. *Jakarta Islamic Index* 17

 4. Covid-19..... 17

 5. *Work From Home* 18

 6. Saham 20

 7. Efisiensi Pasar 23

 8. Studi Peristiwa (*Event Study*) 25

 9. *Abnormal Return* 26

 10. *Trading Volume Activity* 28

 11. *Security Return Variability* 29

 B. Penelitian Terdahulu 31

 C. Kerangka Berfikir 34

 D. Hipotesis 35

BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan	39
B. Setting Penelitian.....	40
C. Populasi dan Sampel	41
D. Desain dan Definisi Operasional Variabel.....	44
E. Teknik Pengumpulan Data	48
F. Teknik Analisis Data	48
 BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian	50
1. Gambaran Obyek Penelitian.....	50
2. Analisis Data Penelitian	51
B. Pembahasan Hasil Analisis Data.....	64
 BAB V PENUTUP	
A. Simpulan	70
B. Keterbatasan Penelitian	70
C. Saran	71
 DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu.....	31
Tabel 3.1	Daftar Sampel Perusahaan.....	42
Tabel 3.2	Rumus Perhitungan <i>Abnormal Return</i>	44
Tabel 3.3	Rumus Perhitungan <i>Treding Volume Activity</i>	46
Tabel 3.4	Rumus Perhitungan <i>Security Return Variability</i>	47
Tabel 4.1	Daftar Nama Emiten yang Terdaftar di JII pada tahun 2020	50
Tabel 4.2	Uji Deskriptif Data (<i>Abnormal Return</i>)	53
Tabel 4.3	Uji Deskriptif Data (<i>Trading Volume Activity</i>).....	55
Tabel 4.4	Uji Deskriptif Data (<i>Security Return Variability</i>).....	56
Tabel 4.5	Uji Normalitas Data (<i>Abnormal Return</i>).....	57
Tabel 4.6	Uji Normalitas Data (<i>Trading Volume Activity</i>).....	58
Tabel 4.7	Uji Normalitas Data (<i>Security Return Variability</i>).....	59
Tabel 4.8	<i>Paired Samples Statistic Abnormal Return</i>	60
Tabel 4.9	Uji <i>Paired Sample T-Test Abnormal Return</i> ...	61
Tabel 4.10	<i>Paired Samples Statistic Trading Volume Activity</i>	62
Tabel 4.11	Uji <i>Paired Sample T-Test Trading Volume Activity</i>	63
Tabel 4.12	Uji <i>Wilcoxon Signed T-Test Security Return Variability</i>	74

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Data Data pertumbuhan ekonomi Indonesia triwulan I-2020.....	7
Gambar 1.2	Chart JII Sebelum, Saatdan Setelah Peristiwa WFH padaMaret 2020.....	8
Gambar 2.3	Model KerangkaPemikiran Penelitian	34
Gambar 3.1	Periode Pengamatan	41

