

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
NOTA PERSETUJUAN PEMBIMBING	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 GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GRAFIK	xv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	10
C. Tujuan Penelitian	10
D. Manfaat Penelitian	11
E. Sistematika Penulisan	11
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori	13
1. Teori <i>Efficient Market Hypothesis</i>	13
2. <i>Event Studies</i>	19
3. Saham	22
4. Pasar Modal	25
5. <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	31
6. Harga Saham	32
7. <i>Trading volume activity</i>	36
8. Pandemi Covid-19	38
B. Penelitian Terdahulu	44
C. Kerangka Berfikir	49
D. Hipotesis	50
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian	54
B. Populasi dan Sampel	55

C. Identifikasi Variabel	57
D. Variabel Operasional	59
E. Teknik Pengumpulan Data	60
F. Teknik Analisis Data	61
1. Statistik Deskriptif	61
2. Uji Normalitas	62
3. Uji Hipotesis	63

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Hasil Penelitian	65
a. Deskripsi Data	65
b. Uji Normalitas	83
c. Hasil Uji Hipotesis	84
B. Pembahasan	89

BAB V PENUTUP

A. Simpulan	95
B. Keterbatasan Penelitian	96
C. Saran-Saran	96

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Tingkat Kumulatif Ketiga Bentuk Pasar.....	19
Gambar 2.2 Kerangka Berfikir.....	48
Gambar 3.1 Periode Pengamatan	55



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Jumlah Populasi Perusahaan Industri <i>Property Real Estate</i> dan Konstruksi Bangunan Serta Telekomunikasi yang Terdaftar di JII.....	52
Tabel 3.2 Jumlah Sampel perusahaan Sektor Industri <i>Property Real Estate</i> Dan Konstruksi Bangunan Serta Telekomunikasi yang Terdaftar di JII.....	54
Tabel 3.3 Definisi Operasional Variabel	56
Tabel 4.1 Hasil Statistik Deskriptif Harga Saham Periode Sebelum Dan Sesudah	67
Tabel 4.2 Hasil Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum Dan Sesudah	74
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas Kolmogorov-smirnov Pada Saham Syariah Sektor <i>Property Real Estate</i> dan Konstruksi Bangunan Serta Telekomunikasi yang Terdaftar di JII.....	83
Tabel 4.4 Output Rank Wilcoxon Signed Ranks Test Untuk Harga Saham	85
Tabel 4.5 Output Rank Wilcoxon Signed Rank Test Untuk <i>Trading Volume Activity</i>	88

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 Harga Saham Di JII Lima Belas Hari Pengamatan	70
Grafik 4.2 <i>Trading volume activity</i> di JII Lima Belas Hari Pengamatan	70