

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
NOTA PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
PENGESAHAN MUNAQOSYAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
MOTTO.....	vi
PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	12
C. Tujuan Penelitian	12
D. Manfaat Penelitian.....	12
E. Sistematika Penulisan	13
 BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori	15
1. <i>Efficient Market Hypotesis</i>	15
a. Teori <i>Efficiency Market Hypotesis</i>	15
b. Alasan Pasar Efisien dan Tidak Efisien	16
c. Bentuk-bentuk Pasar Efisien	17
2. <i>Event Study</i>	19
3. <i>Abnormal Return</i>	21
a. <i>Return Realisasi (Actual Return)</i>	21
b. <i>Return Ekspektasi (expected return)</i>	22
c. <i>Abnormal Return</i>	24
4. <i>Trading Volume Activity</i>	24
5. Pasar Modal Syariah	26
a. Pengertian Pasar Modal Syariah	26
b. Landasan Hukum Pasar Modal Syariah.....	27
c. Pasar Modal Syariah dan Prinsip-prinsipnya.....	28

d.	Instrumen di Pasar Modal Syariah	29
e.	Fungsi Pasar Modal	30
f.	Perbedaan Pasar Modal Syariah dan Konvensional.....	31
6.	Saham Syariah	31
a.	Pengertian Saham Syariah.....	31
b.	Kriteria Saham Syariah	32
c.	Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	34
7.	Indeks Saham Syariah	36
a.	Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI)	36
b.	<i>Jakarta Islamic Index 70 (JII70)</i>	37
c.	<i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	37
8.	Peristiwa Pemilihan Presiden.....	39
B.	Penelitian Terdahulu.....	41
C.	Kerangka Berfikir	46
D.	Hipotesis	46
1.	Pemilihan Presiden Amerika dan <i>Trading Volume Activity</i>	47
2.	Pemilihan Presiden Amerika dan <i>Abnormal Return</i>	47

BAB III METODE PENELITIAN

A.	Jenis dan Sumber Data	49
B.	Desain Penelitian	49
C.	Populasi dan Sampel.....	50
D.	Variabel dan Definisi Operasional Variabel.....	51
E.	Teknik Pengolahan Data.....	53
F.	Metode Analisis Data	55

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A.	Deskripsi Penelitian.....	58
B.	Analisis Data.....	58
1.	Statistik Deskriptif	58
2.	Uji Normalitas.....	71
3.	Uji Hipotesis	73

C. Pembahasan	75
1. Perbedaan Rata-rata <i>Abnormal return</i> Sebelum dan Sesudah Pemilihan Presiden Amerika 2020.....	76
2. Perbedaan Rata-rata Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Pemilihan Presiden Amerika 2020.....	78
3. Pengaruh Informasi dalam Integrasi Islam.....	79

BAB V PENUTUP

A. Simpulan.....	82
B. Saran.....	82

DAFTAR PUSTAKA

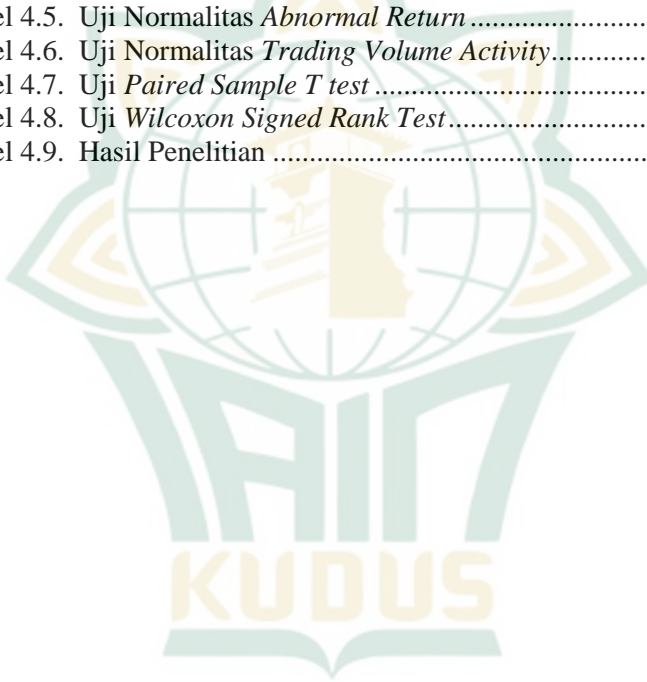
LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT PENDIDIKAN PENELITI



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1. Sampel Penelitian	50
Tabel 3.2. Definisi Operasional Variabel	52
Tabel 4.1. Statistik Deskriptif <i>Abnormal return</i>	59
Tabel 4.2. Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pilpres Amerika 2020.....	61
Tabel 4.3. Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	66
Tabel 4.4. Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Pilpres Amerika 2020.....	68
Tabel 4.5. Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	72
Tabel 4.6. Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	72
Tabel 4.7. Uji <i>Paired Sample T test</i>	74
Tabel 4.8. Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test</i>	75
Tabel 4.9. Hasil Penelitian	75



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Kerangka Berfikir..... 46
 Gambar 3.1. Periode Pengamatan 50
 Gambar 4.1. Pergerakan *Abnormal Return* Sebelum dan
 Sesudah Pilpres Amerika 2020 60
 Gambar 4.2. Pergerakan *Trading Volume Activity* Sebelum
 dan Sesudah Pilpres Amerika 2020..... 67

