

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI .....</b>	<b>ii</b>
<b>PENGESAHAN MUNAQOSYAH .....</b>	<b>iii</b>
<b>PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI .....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>v</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>vi</b>
<b>PERSEMBAHAN .....</b>	<b>vii</b>
<b>PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN .....</b>	<b>viii</b>
<b>KATA PENGANTAR .....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR ISI .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR SINGKATAN .....</b>	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang .....	1
B. Rumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian .....	8
D. Manfaat Penelitian .....	8
E. Sistematika Penulisan .....	9
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b>	
A. Deskripsi Teori .....	10
1. <i>Efficient Market Hypothesis</i> .....	10
2. <i>Return Saham</i> .....	13
3. <i>Abnormal Return</i> .....	15
4. <i>Trading Volume Activity</i> .....	16
5. <i>Stock Split</i> .....	17
6. <i>Event Study</i> .....	18
7. Pasar Modal Syariah .....	19
8. Saham Syariah .....	22
9. <i>Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI)</i> .....	23
B. Penelitian Terdahulu .....	24
C. Kerangka Berpikir .....	27
D. Hipotesis .....	29
1. Perbedaan Rata-rata <i>Abnormal Return</i> sebelum dan sesudah <i>Stock Split</i> .....	29

2. Perbedaan Rata-rata <i>Trading Volume Activity</i> sebelum dan sesudah <i>Stock Split</i> .....	30
--	----

### **BAB III METODE PENELITIAN**

A. Jenis dan Pendekatan Penelitian .....	32
B. Sumber Data .....	32
C. Populasi dan Sampel .....	33
D. Identifikasi Variabel Penelitian .....	35
E. Periode Pengamatan .....	36
F. Definisi Operasional Variabel .....	36
G. Teknik Pengumpulan Data .....	38
H. Teknik Analisis Data .....	39
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	39
2. Uji Normalitas .....	39
3. Uji Hipotesis .....	40

### **BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

A. Hasil Penelitian .....	42
1. Gambaran Objek Penelitian .....	42
2. Analisis Data .....	48
a. Analisis Statistik Deskriptif .....	48
b. Uji Normalitas .....	49
c. Uji Hipotesis Data .....	52
B. Pembahasan .....	54
1. Pembahasan <i>Abnormal Return</i> .....	54
2. Pembahasan <i>Trading Volume Activity</i> .....	56

### **BAB V PENUTUP**

A. Kesimpulan .....	58
B. Saran-saran .....	58

<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	<b>xvi</b>
<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN</b> .....	<b>xxiii</b>
<b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP</b> .....	<b>xxxiv</b>

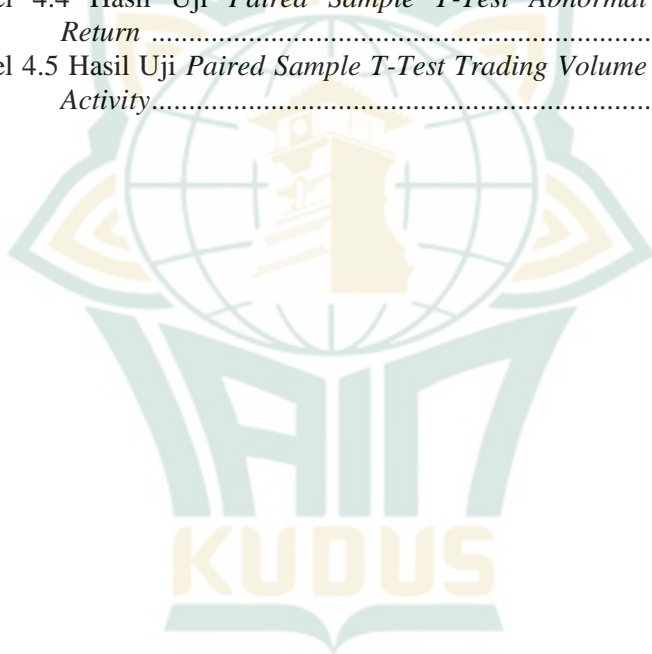
**DAFTAR SINGKATAN**

BEI	: Bursa Efek Indonesia
DES	: Daftar Efek Syariah
DSN-MUI	: Dewan Syariah Nasional-Majelis Ulama Indonesia
ISSI	: Indeks Saham Syariah Indonesia
OJK	: Otoritas Jasa Keuangan
AR	: <i>Abnormal Return</i>
TVA	: <i>Trading Volume Activity</i>



## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Hasil Penelitian Terdahulu .....	24
Tabel 3.1 Klasifikasi Sampel Penelitian .....	34
Tabel 3.2 Sampel Penelitian .....	34
Tabel 3.3 Definisi Operasional Variabel .....	37
Tabel 4.1 Hasil Uji Analisis Statistik Deskriptif .....	48
Tabel 4.2 Hasil Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> .....	50
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i> .....	51
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Paired Sample T-Test Abnormal Return</i> .....	52
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Paired Sample T-Test Trading Volume Activity</i> .....	53



**DAFTAR GAMBAR**

Gambar 2.1 Kerangka Berpikir ..... 28  
Gambar 3.1 Periode Pengamatan ..... 36

