

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN.....	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah.....	6
1.3. Pertanyaan Penelitian	7
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Lingkup Penelitian.....	9
1.7. Sistematika Penulisan	10
BAB II LANDASAN TEORI.....	12
2.1. Landasan Teori.....	12
2.1.1. Pasar Modal (<i>Capital Market</i>).....	12
2.1.2. <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	13
2.1.3. Studi Peristiwa (<i>Event study</i>).....	15
2.1.4. <i>Return</i> taknormal (<i>Abnormal return - AR</i>).....	20
2.1.5. Volume Perdagangan (<i>Trading Volume Activity</i>).....	22
2.1.6. <i>Earnings Per Share (EPS)</i>	22
2.1.7. <i>Debt to Total Asset Ratio (DAR)</i>	23
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	24

2.3.	Perumusan Hipotesis	28
2.2.1.	Hipotesis substitusi tidak sempurna (<i>imperfect substitute hypothesis</i>)	28
2.2.2.	Hipotesis tekanan harga (<i>the price pressure hypothesis</i>)	29
2.2.3.	Hipotesis kesadaran (<i>the awareness hypothesis</i>)	30
2.2.4.	Hipotesis likuiditas (<i>the liquidity hypothesis</i>)	31
2.2.5.	Hipotesis sinyal (<i>signaling hypothesis</i>)	32
2.4.	Model Penelitian	34
BAB III METODA PENELITIAN		35
3.1.	Desain Penelitian	35
3.2.	Metoda Pengumpulan Data	36
3.3.	Instrumen Penelitian	37
3.3.1.	Studi Peristiwa (<i>event study</i>)	37
3.3.2.	Variabel Dependen	41
3.3.3.	Variabel Independen	42
3.4.	Metoda Analisis Data	43
3.4.1.	Uji Asumsi Klasik	44
3.4.2.	Pengujian Hipotesis	46
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		48
4.1.	Deskripsi Data	48
4.2.	Pengujian Hipotesis 1	49
4.2.1.	CAAR Saham Masuk	50
4.2.2.	Uji Hipotesis 1	51
4.3.	Pengujian Hipotesis 2	53
4.3.1.	CAAR Saham Keluar	53
4.3.2.	Uji Hipotesis 2	54
4.4.	Pengujian Regresi Saham Masuk	57
4.4.1.	Uji Asumsi Klasik	57
4.4.2.	Analisis Regresi Berganda Saham Masuk	61
4.5.	Pengujian Regresi Saham Keluar	63

4.5.1. Uji Asumsi Klasik	63
4.5.2. Analisis Regresi Berganda Saham Keluar	67
4.6. Diskusi dan Pembahasan	69
BAB V SIMPULAN.....	72
5.1. Simpulan	72
5.2. Implikasi	73
5.3. Keterbatasan.....	74
5.4. Saran.....	74
DAFTAR PUSTAKA.....	75
LAMPIRAN.....	77