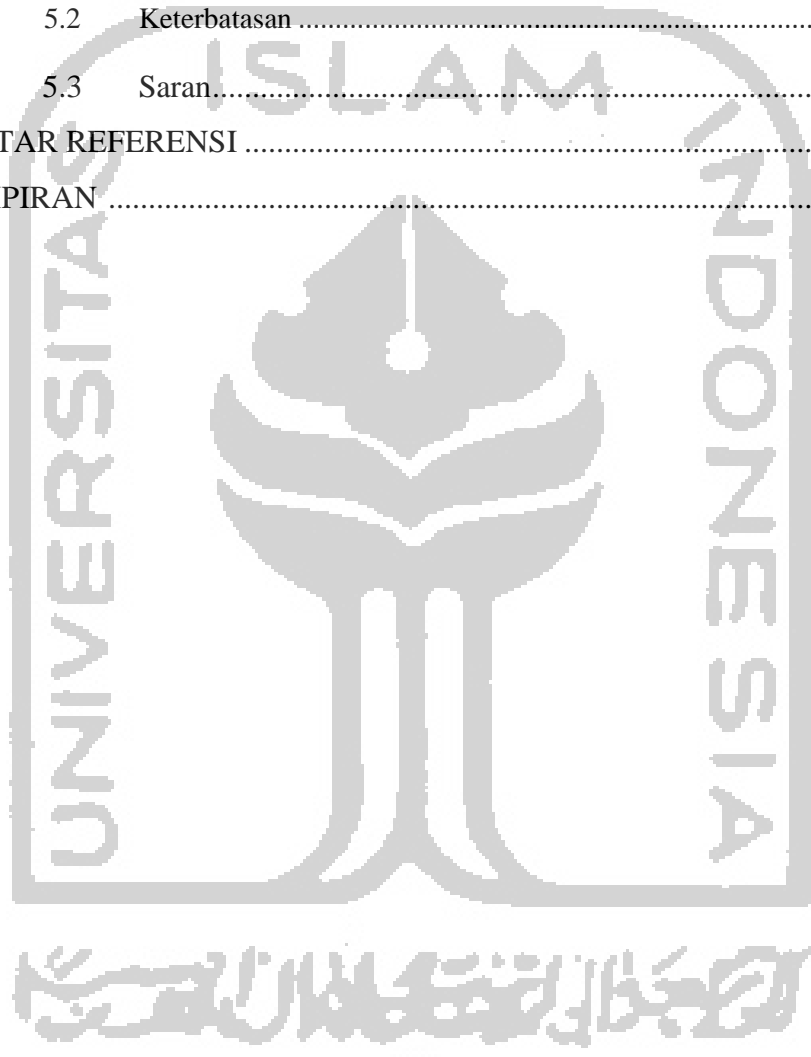


DAFTAR ISI

PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME.....	Error! Bookmark not defined.
HALAMAN PENGESAHAN.....	Error! Bookmark not defined.
HALAMAN MOTTO	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
ABSTRACT.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Tujuan Penelitian	4
1.4. Manfaat Penelitian.....	5
1.5. Sistematika Pembahasan.....	5
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	7
2.1. Landaran Teori dan Pengertian Variabel.....	7
2.1.1. <i>Signalling theory</i>	7
2.1.2. Pasar Modal.....	7
2.1.3. Pasar Modal Syariah.....	8
2.1.4. <i>Jakarta Islamic Indeks</i>	10
2.1.5. Pemilihan Umum Presiden dan Wakil Presiden 2019.....	11
2.1.6. <i>Event Study</i>	12
2.1.7. <i>Abnormal Return</i>	13
2.1.8. <i>Trading Volume Activity</i>	14
2.1.9. <i>Security Return Variability</i>	14
2.2. Penelitian Terdahulu.....	15

2.3.	Hipotesis Penelitian	17
2.3.1.	<i>Abnormal Return</i>	17
2.3.2.	<i>Trading Volume Activity</i>	18
2.3.3.	<i>Security Return Variability</i>	18
2.4.	Kerangka Pemikiran	20
BAB III METODE PENELITIAN.....		21
3.1.	Populasi dan Sampel.....	21
3.2.	Sumber Data	21
3.3.	Teknik Pengumpulan Data	22
3.4.	Periode Penelitian	22
3.5.	Definisi dan Pengukuran Variabel.....	23
3.5.1.	<i>Abnormal Return Saham</i>	23
3.5.2.	<i>Trading Volume Activity</i>	25
3.5.3.	<i>Security Return Variability</i>	26
3.6.	Analisis Statistik Deskriptif	27
3.7.	Asumsi Klasik	27
3.7.1.	Uji Normalitas.....	27
3.8.	Uji Beda	28
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....		29
4.1.	Deskripsi Objek Penelitian	29
4.2.	Statistik Deskriptif	29
4.3.	Uji Asumsi Klasik.....	36
4.3.1.	Uji Normalitas	36
4.4.	Pengujian Hipotesis	39
4.5.	Pembahasan.....	43
4.5.1.	Pengaruh Pilpres 2019 terhadap <i>Abnormal Return</i>	43

4.5.2.	Pengaruh Pilpres 2019 terhadap <i>Trading Volume Activity</i>	44
4.5.3.	Pengaruh Pilpres 2019 terhadap <i>Security Return Variability</i>	45
BAB V KESIMPULAN, SARAN DAN IMPLIKASI		47
5.1	Kesimpulan	47
5.2	Keterbatasan	47
5.3	Saran.....	48
DAFTAR REFERENSI		47
LAMPIRAN		52

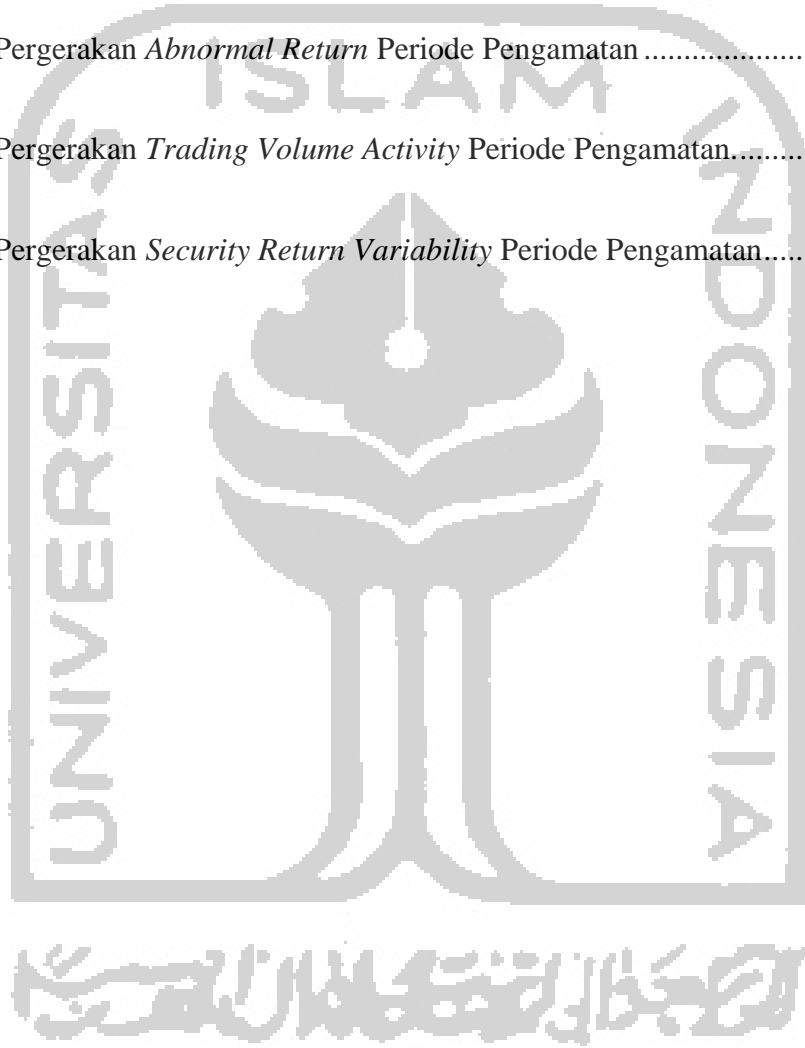


DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1. Peneliti Terdahulu	15
Tabel 3. 1. Tahapan Menghitung <i>Abnormal Return</i>	23
Tabel 3. 2. Tahapan Menghitung <i>Trading Volume Activity</i>	25
Tabel 3. 3. Tahapan Menghitung <i>Security Return Variability</i>	26
Tabel 4. 1. Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Periode Pengamatan	30
Tabel 4. 2. Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i> Periode Pengamatan ...	32
Tabel 4. 3. Statistik Deskriptif <i>Security Return Variability</i> Periode Pengamatan .	34
Tabel 4. 4. Uji Normalitas Data <i>Abnormal Return</i>	37
Tabel 4. 5. Uji Normalitas Data <i>Trading Volume Activity</i>	38
Tabel 4. 6. Uji Normalitas Data <i>Security Return Variability</i>	39
Tabel 4. 7. Uji Paired T-test <i>Average Abnormal Return</i>	40
Tabel 4. 8. Uji <i>Wilcoxon Signed Ranks Average Trading Volume Activity</i>	41
Tabel 4. 9. Uji <i>Paired T-test Average Security Return Variability</i>	42

DAFTAR GAMBAR

2. 1. Kerangka Pemikiran Penelitian.....	20
4. 1. Pergerakan <i>Abnormal Return</i> Periode Pengamatan	31
4. 2. Pergerakan <i>Trading Volume Activity</i> Periode Pengamatan.....	33
4. 3. Pergerakan <i>Security Return Variability</i> Periode Pengamatan.....	35



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Daftar Sampel Perusahaan di <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	53
Lampiran 2 : Harga Penutupan Saham Sebelum Peristiwa.....	54
Lampiran 3 : Harga Penutupan Saham Setelah Peristiwa.....	55
Lampiran 4 : <i>Actual Return</i> Sebelum Peristiwa.....	56
Lampiran 5 : <i>Actual Return</i> Sebelum Peristiwa.....	57
Lampiran 6 : <i>Expected Return</i>	58
Lampiran 7 : <i>Abnormal Return</i>	59
Lampiran 8 : Volume Saham.....	60
Lampiran 9 : <i>Listed Share</i>	61
Lampiran 10 : <i>Trading Volume Acitivity</i>	62
Lampiran 11 : <i>Security Return Variability</i>	63
Lampiran 12 : Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	64
Lampiran 13 : Statistik Deskriptif <i>Trading Volume Activity</i>	65
Lampiran 14 : Statistik Deskriptif <i>Security Return Variabiliy</i>	66
Lampiran 15 : Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	67
Lampiran 16 : Uji Normalitas <i>Trading Volume Activity</i>	68
Lampiran 17 : Uji Normalitas <i>Security Return Variability</i>	68
Lampiran 18 : Uji Hipotesis <i>Abnormal Return</i>	69
Lampiran 19 : Uji Hipotesis <i>Trading Volume Activity</i>	69
Lampiran 20 : Uji Hipotesis <i>Security Return Variability</i>	70