

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
1.5 Sistematika Penulisan	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Reaksi Pasar	10
2.2 Pasar Modal	10
2.2.1 Pengertian Pasar Modal.....	10
2.2.2 Peranan Pasar Modal	11
2.2.3 Manfaat Pasar Modal	12
2.3 Saham Syari'ah	13
2.4 Return dan <i>Abnormal Return</i>	18
2.4.1 Pengertian Return	18
2.4.2 Macam-macam Return	19
2.4.3 Pengertian <i>Abnormal Return</i>	19
2.4.4 Rumus-rumus <i>Abnormal Return</i>	20
2.4.5 Jenis <i>Abnormal Return</i>	22
2.5 Risiko	24
2.6 Risiko Negara (<i>Country Risk</i>)	25
2.6.1 Pengertian <i>Country Risk</i>	25
2.6.2 Faktor-faktor yang menentukan <i>Country Risk</i>	25
2.7 Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	27
2.8 Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	28
2.8.1 Pengertian Studi Peristiwa	28
2.8.2 Prosedur Studi Peristiwa	29
2.9 Peristiwa Bom Surabaya 2018.....	30
2.10 <i>JII</i> dalam Perspektif Islam	32
2.11 Penelitian Terdahulu	35

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

2.12 Variabel Penelitian dan Defenisi Operasional Variabel	39
2.13 Kerangka Penelitian	41
2.14 Hipotesis	42

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Lokasi Penelitian	43
3.2 Sumber Data	43
3.3 Populasi dan Sampel	43
3.4 Metode Pengumpulan Data	45
3.5 Metode Analisis Data	45
3.5.1 Analisis Data 1	46
3.5.2 Analisis Data 2	48
3.5.3 Merumuskan Hipotesis	50
3.5.4 Uji Asumsi Klasik Normalitas	51
3.5.5 Uji-t	51

BAB IV GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN

4.1 Sejarah Pasar Modal Indonesia	52
4.2 Sejarah <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII)	54

BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

5.1 Hasil Penelitian	56
5.2 Menghitung <i>Actual Return</i>	59
5.3 Menghitung <i>Expected Return</i>	60
5.4 Menghitung <i>Abnormal Retutn</i>	61
5.5 Menghitung <i>Average Abnormal Return</i>	62
5.6 Analisis Deskriptif	63
5.7 Uji Normalitas	64
5.8 Pengujian Hipotesis	66
5.9 Pembahasan	69

BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN

6.1 Kesimpulan	72
6.2 Saran	73

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN