

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	i
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINILITAS SKRIPSI.....	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
ABSTRAK.....	v
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	9
1.3 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Manfaat Penelitian.....	11
1.5 Sistematika Penulisan.....	12

BAB II.....	14
TINJAUAN PUSTAKA	14
2.1 Landasan Teori	14
2.1.1 <i>Signalling Theory</i> (Teori Sinyal)	14
2.1.2 Teori Pasar Efisien	16
2.2 Pasar Modal Syariah.....	17
2.3 Perbankan Syariah	19
2.3.1 Saham Syariah.....	23
2.3.2 Peluang Investasi (<i>Growth</i>).....	25
2.3.3 <i>Market Value</i> (MV).....	26
2.3.4 Rasio Aktivitas (TATO).....	26
2.3.5 <i>Solvency Ratio</i> (DER)	27
2.3.6 <i>Abnormal Return</i> (AR).....	28
2.3.7 <i>Cumulative Abnormal Return</i> (CAR)	29
2.4 Penelitian Terdahulu.....	29
2.5 Pengaruh Antar Variabel	47
2.5.1 Pengaruh peluang investasi (<i>Growth</i>) terhadap CAR	47
2.5.2 Pengaruh <i>market value</i> (MV) terhadap CAR.....	49
2.5.3 Pengaruh rasio aktivitas (TATO) terhadap CAR.....	51
2.5.4 Pengaruh <i>solvency ratio</i> (DER) terhadap CAR	53

2.6	Kerangka Berpikir Teoritis.....	54
2.7	Hipotesis.....	55
BAB III		57
METODE PENELITIAN.....		57
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	57
3.1.1	Variabel Penelitian	57
3.1.2	Definisi Operasional.....	58
3.2	Populasi dan Sampel Penelitian	64
3.3	Jenis dan Sumber Data	65
3.4	Metode Pengumpulan Data	65
3.5	Metode Analisis Data	66
3.5.1	Uji Asumsi Klasik.....	66
3.5.2	Analisis Regresi Linier Berganda	70
3.5.3	Uji Hipotesis	71
BAB IV		75
PEMBAHASAN DAN ANALISIS DATA		75
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	75
4.2	Analisis Data	76
4.2.1	Statistik Deskriptif	76
4.2.2	Uji Asumsi Klasik.....	79

4.2.3	Uji Regresi Linier Berganda	87
4.2.4	Uji Hipotesis	89
4.3	Interpretasi Hasil	94
4.3.1	Variabel peluang investasi (<i>growth</i>) berpengaruh negatif terhadap CAR saham syariah.	94
4.3.2	Variabel <i>market value</i> (MV) berpengaruh negatif terhadap CAR saham syariah.....	96
4.3.3	Variabel rasio aktivitas (TATO) berpengaruh positif terhadap CAR saham syariah.....	98
4.3.4	Variabel <i>solvency ratio</i> (DER) berpengaruh negatif terhadap CAR saham syariah.....	100
BAB V.....		103
KESIMPULAN.....		103
5.1	Kesimpulan.....	103
5.2	Keterbatasan Penelitian	104
5.3	Saran.....	104
DAFTAR PUSTAKA		106
LAMPIRAN.....		113