

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRACT	ix
ABSTRAK	x
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	15
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	16
1.3.1 Tujuan Penelitian	16
1.3.2 Kegunaan Penelitian	17
1.4 Sistematika Penulisan	17
BAB II TELAAH PUSTAKA	19
2.1 Landasan Teori	19
2.1.1 Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	19
2.1.1.1 Hipotesis Pasar Efisien Bentuk Lemah (<i>Weak Form of the EMH</i>)	21
2.1.1.2 Hipotesis Pasar Efisien Bentuk Setengah Kuat (<i>Semi-Strong Form of the EMH</i>)	22
2.1.1.3 Hipotesis Pasar Efisien Bentuk Kuat (<i>Strong Form of the EMH</i>)	23
2.1.2 Saham	24
2.1.3 Anomali Pasar (<i>Market Anomaly</i>)	26
2.1.4 Abnormal Return	28

2.2 Penelitian Terdahulu	31
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis	40
BAB III METODE PENELITIAN	42
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	42
3.1.1 Variabel Penelitian	42
3.1.2 Definisi Operasional	42
3.2 Jenis dan Sumber Data	45
3.3 Metode Analisis	47
3.3.1 Uji Normalitas	47
3.3.2 <i>Paired Sample t-Test</i>	47
3.3.3 <i>Wilcoxon Signed Ranks</i>	47
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	49
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	49
4.2 Analisis Data	50
4.2.1 Statistik Deskriptif	50
4.2.1 Uji Normalitas Data	52
4.2.2 Uji Perbedaan Abnormal Return	53
4.3 Interpretasi Hasil	55
4.3.1 Perbedaan Abnormal Return Sebelum dan Saat Ramadan Tahun 2019-2023	59
4.3.2 Perbedaan Abnormal Return Saat dan Setelah Ramadan Tahun 2019-2023	62
4.3.3 Perbedaan Abnormal Return Sebelum dan Setelah Ramadan Tahun 2019-2023	64
BAB V PENUTUP	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Keterbatasan	68
5.3 Saran	68
DAFTAR PUSTAKA	70
LAMPIRAN-LAMPIRAN	74