DAFTAR ISI

[HALAMAN JUDL i](#_Toc515903710)

[HALAMAN PENGESAHAN ii](#_Toc515903711)

[PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI iv](#_Toc515903712)

[PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH v](#_Toc515903713)

[ABSTRAK vi](#_Toc515903714)

[MOTTO DAN PERSEMBAHAN viii](#_Toc515903715)

[KATA PENGANTAR ix](#_Toc515903716)

[DAFTAR ISI xii](#_Toc515903717)

[DAFTAR TABEL xv](#_Toc515903718)

[DAFTAR LAMPIRAN xvi](#_Toc515903719)

[BAB I PENDAHULUAN 1](#_Toc515903720)

[1.1 Latar Belakang Penelitian 1](#_Toc515903721)

[1.2 Rumusan Masalah 8](#_Toc515903722)

[1.3 Tujuan Penelitian 8](#_Toc515903723)

[1.4 Manfaat Penelitian 9](#_Toc515903724)

[1.4.1 Manfaat Teoritis 9](#_Toc515903725)

[1.4.2 Manfaat Praktis 9](#_Toc515903726)

[BAB II KAJIAN PUSTAKA 12](#_Toc515903727)

[2.1 Investasi di Pasar Modal 12](#_Toc515903728)

[2.2 Klasifikasi Pasar Modal berdasarkan Efisiensinya 13](#_Toc515903729)

[2.3 Anomali Pasar Modal 14](#_Toc515903730)

[2.4 *Return* Saham 15](#_Toc515903731)

[2.5 *Abnormal Return/Excess Return* (*Return* Taknormal) 19](#_Toc515903732)

[2.6 Penelitian Terdahulu 19](#_Toc515903733)

[2.7 Kerangka Pemikiran Teoritis dan Pengembangan Hipotesis 22](#_Toc515903734)

[2.7.1 Kerangka Pemikiran Teoritis 22](#_Toc515903735)

[2.7.2 Pengembangan Hipotesis 23](#_Toc515903736)

[BAB III METODE PENELITIAN 27](#_Toc515903737)

[3.1 Jenis Penelitian 27](#_Toc515903738)

[3.2 Populasi, Sampel, dan Teknik Sampel 27](#_Toc515903739)

[3.2.1 Populasi 27](#_Toc515903740)

[3.2.2 Sampel 27](#_Toc515903741)

[3.3 Sumber & Metode Pengumpulan Data 28](#_Toc515903742)

[3.4 Definisi Operasional Variabel 29](#_Toc515903743)

[3.5 Teknik Analisis Data 31](#_Toc515903744)

[3.5.1 Event Study 31](#_Toc515903745)

[3.5.2 Analisis Deskriptif 32](#_Toc515903746)

[3.5.3 Uji Asumsi Klasik 32](#_Toc515903747)

[3.5.3.1 Uji Normalitas Data 33](#_Toc515903748)

[3.5.3.2 Uji Heteroskedatisitas 33](#_Toc515903749)

[3.5.3.3 Uji Autokorelasi 33](#_Toc515903750)

[3.5.4 Uji Regresi dengan Variabel Dummy 34](#_Toc515903751)

[3.5.5 Uji Koefisien Determinasi (R2) 35](#_Toc515903752)

[3.5.6 Uji Hipotesis 35](#_Toc515903753)

[3.5.6.1 Uji t 35](#_Toc515903754)

[3.5.6.2 Uji Beda 36](#_Toc515903755)

[BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 40](#_Toc515903756)

[4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian 40](#_Toc515903757)

[4.2 Deskripsi Variabel Penelitian 39](#_Toc515903758)

[4.3 Pengujian Hipotesis 44](#_Toc515903759)

[4.3.1 Uji Asumsi Klasik 44](#_Toc515903760)

[4.3.1.1 Uji Normalitas Data 45](#_Toc515903761)

[4.3.1.2 Uji Heteroskedatisitas 45](#_Toc515903762)

[4.3.1.3 Uji Autokorelasi 46](#_Toc515903763)

[4.3.2 Uji Regresi dengan Variabel Dummy 47](#_Toc515903764)

[4.3.3 Uji t 48](#_Toc515903765)

[4.3.4 Uji Koefisien Determinasi (R2) 48](#_Toc515903766)

[4.3.5 Uji Beda 49](#_Toc515903767)

[4.3.5.1 Uji Beda *Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Isra Mi’raj 49](#_Toc515903768)

[4.3.5.2 Uji Beda *Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Idul Fitri 50](#_Toc515903769)

[4.3.5.3 Uji Beda *Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Idul Adha 51](#_Toc515903770)

[4.3.5.4 Uji Beda *Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Tahun Baru Hijriyah 52](#_Toc515903771)

[4.3.5.5 Uji Beda *Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Maulid Nabi 53](#_Toc515903772)

[4.3.5.6 Uji Beda *Average Abnormal Return* Sebelum dan Sesudah Hari Besar Islam 54](#_Toc515903773)

[4.4 Pembahasan 55](#_Toc515903774)

[4.4.1 Pengaruh Hari Besar Islam terhadap *return* Indeks Harga Saham Konsumsi di BEI tahun 2015-2017 55](#_Toc515903775)

[4.4.2 Pengaruh *return* IHSK periode t-1 terhadap *return* IHSK periode t di tahun 2015 – 2017 56](#_Toc515903776)

[4.4.3 Perbedaan *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Isra Mi’raj 57](#_Toc515903777)

[4.4.4 Perbedaan *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Idul Fitri 58](#_Toc515903778)

[4.4.5 Perbedaan *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Idul Adha 59](#_Toc515903779)

[4.4.6 Perbedaan *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Tahun Baru Hijriyah 60](#_Toc515903780)

[4.4.7 Perbedaan *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Maulid Nabi 61](#_Toc515903781)

[4.4.8 Perbedaan *Average* *Abnormal Return* Indeks Harga Saham Konsumsi sebelum dan sesudah Hari Besar Islam 62](#_Toc515903782)

[4.5 Implikasi Manajerial 63](#_Toc515903783)

[BAB V PENUTUP 65](#_Toc515903784)

[5.1 Kesimpulan 65](#_Toc515903785)

[5.2 Saran 65](#_Toc515903786)

[5.3 Keterbatasan Penelitian dan Agenda Penelitian Mendatang 66](#_Toc515903787)

[DAFTAR PUSTAKA 67](#_Toc515903788)

[LAMPIRAN 69](#_Toc515903789)

# DAFTAR TABEL

[Tabel 1.1 Indeks Harga Konsumen Bulanan Indonesia](#_Toc515279572) 5

[Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu](#_Toc515279572) 20

[Tabel 4.1 Hari Besar Islam Tahun 2015-2017 39](#_Toc515279572)

[Tabel 4.2 Perusahaan Tercatat BEI yang Menjadi Sampel Penelitian 39](#_Toc515279573)

[Tabel 4.3 Deskriptif Return IHSK Selama Hari Besar Islam Tahun 2015-2017 40](#_Toc515279574)

[Tabel 4.4 Deskriptif AR IHSK Selama Isra Miraj Tahun 2015-2017 40](#_Toc515279575)

[Tabel 4.5 Deskriptif AR IHSK Selama Idul Fitri Tahun 2015-2017 41](#_Toc515279576)

[Tabel 4.6 Deskriptif AR IHSK Selama Idul Adha Tahun 2015-2017 42](#_Toc515279577)

[Tabel 4.7 Deskriptif AR IHSK Selama Tahun Baru Hijriyah Tahun 2015-2017 42](#_Toc515279578)

[Tabel 4.8 Deskriptif AR IHSK Selama Maulid Nabi Tahun 2015-2017 43](#_Toc515279579)

[Tabel 4.9 Deskriptif AR IHSK Selama Hari Besar Islam Tahun 2015-2017 43](#_Toc515279580)

[Tabel 4.10 Uji Normalitas Return IHSK Tahun 2015 - 2017 45](#_Toc515279581)

[Tabel 4.11 Uji Heteroskedatisitas 46](#_Toc515279582)

[Tabel 4.12 Uji Autokorelasi 46](#_Toc515279583)

[Tabel 4.13 Uji Regresi dengan Variabel Dummy 47](#_Toc515279584)

[Tabel 4.14 Uji Koefisien Determinasi 48](#_Toc515279585)

[Tabel 4.15 Uji Normalitas AR Isra Miraj Tahun 2015-2017 49](#_Toc515279586)

[Tabel 4.16 Uji Beda AR Isra Miraj Tahun 2015-2017 50](#_Toc515279587)

[Tabel 4.17 Uji Normalitas AR Idul Fitri Tahun 2015-2017 50](#_Toc515279588)

[Tabel 4.18 Uji Beda AR Idul Fitri Tahun 2015-2017 51](#_Toc515279589)

[Tabel 4.19 Uji Normalitas AR Idul Adha Tahun 2015-2017 51](#_Toc515279590)

[Tabel 4.20 Uji Beda AR Idul Adha Tahun 2015-2017 52](#_Toc515279591)

[Tabel 4.21 Uji Normalitas AR Tahun Baru Hijriyah Tahun 2015-2017 52](#_Toc515279592)

[Tabel 4.22 Uji Beda AR Tahun Baru Hijriyah Tahun 2015-2017 53](#_Toc515279593)

[Tabel 4.23 Uji Normalitas AR Maulid Nabi Tahun 2015-2017 53](#_Toc515279594)

[Tabel 4.24 Uji Beda AR Maulid Nabi Tahun 2015-2017 54](#_Toc515279595)

[Tabel 4.25 Uji Normalitas AAR Hari Besar Islam Tahun 2015-2017 54](#_Toc515279596)

[Tabel 4.26 Uji Beda AAR Hari Besar Islam Tahun 2015-2017 55](#_Toc515279597)

# DAFTAR LAMPIRAN

[Lampiran 1 Perusahaan Tercatat BEI yang Menjadi Sampel Penelitian 69](#_Toc511129215)

[Lampiran 2 Analisis Statistik](#_Toc511129222) 70