

DAFTAR ISI

	Halaman
<i>ABSTRACT</i>	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PERSETUJUAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Identifikasi Masalah	5
1.3 Pembatasan Masalah	6
1.4 Rumusan Masalah	7
1.5 Maksud dan Tujuan Penelitian	7
BAB II. KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	
2.1 Kajian Teori	8
2.1.1 Signalling Theory.....	8
2.1.2 Capital Asset Pricing Model (CAPM)	10
2.1.3 Arbitrage Pricing Theory	11
2.1.4 Saham Syariah.....	13
2.1.5 Karakteristik Saham Syariah	15
2.1.6 Daya Tahan Saham	17
2.1.7 Guncangan Eksternal	18
2.2 Penelitian Terdahulu	21
2.3 Kerangka Pemikiran	28

2.4 Hipotesis	29
---------------------	----

BAB III. METODE PENELITIAN

3.1 Desain Penelitian	31
3.2 Variabel dan Pengukuran Variabel	32
3.3 Data dan Metode Pengumpulan Data	33
3.4 Populasi dan Metode Sampling	33
3.4.1 Populasi.....	33
3.4.2 Sampel	34
3.5 Metode Analisis	37
3.5.1 Analisis Deskriptif	38
3.5.2 Analisis Independent Simple T-Test	39
3.5.3 Analisis Daya Tahan	40

BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Analisis Karakteristik Saham Syariah dan Saham Non-Syariah.....	43
4.2 Analisis Daya Tahan Saham Syariah dan Non-Syariah terhadap Guncangan Eksternal Tahan.....	45
4.4.1 Hasil Analisis Deskriptif.....	45
4.4.2 Hasil Analisis Marcov-Switching.....	54

BAB V. PENUTUP

5.1 Kesimpulan	62
5.2 Saran	63

DAFTAR PUSTAKA	65
-----------------------------	-----------

LAMPIRAN	69
-----------------------	-----------

DAFTAR RIWAYAT HIDUP	79
-----------------------------------	-----------