

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
ABSTRAK	1
ABSTRACT	2
BAB I PENDAHULUAN.....	3
1.1 Latar Belakang	3
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Pertanyaan Penelitian	9
1.4 Tujuan Penelitian	9
1.5 Manfaat Penelitian	10
1.6 Lingkup Penelitian	10
1.7 Sistematika Penulisan.....	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	13
2.1 Pasar Efisien & Random Walk	13
2.2 <i>Behavioral Finance</i>	15
2.3 Anomali Pasar	17
2.4 Strategi Investasi Aktif dan Pasif.....	23
2.5 Kajian Penelitian terdahulu	25
BAB III METODE PENELITIAN	31
3.1 Sampel dan Data	31
3.2 Variabel Penelitian	34
3.3 Pengujian Hipotesis.....	35
BAB IV ANALISIS & PEMBAHASAN	38
4.1 Statistik Deskriptif <i>January effect</i>	38
4.2 Uji Normalitas	45
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis Pertama	46
4.4 Hasil Pengujian Hipotesis Kedua.....	47

4.5	Hasil Pengujian Hipotesis Ketiga.....	48
4.6	Hasil Pengujian Hipotesis Keempat.....	50
4.7	Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 1 dan Hipotesis 2	51
4.8	Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 3 dan Hipotesis 4	54
BAB V KESIMPULAN & SARAN		58
5.1	Kesimpulan	58
5.2	Implikasi Penelitian.....	58
5.3	Keterbatasan Penelitian	59
5.4	Saran.....	59
Daftar Pustaka.....		61