



Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan	iii
Halaman Pernyataan Keaslian	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vii
Daftar Tabel	ix
Daftar Lampiran.....	x
Intisari	xi
<i>Abstract</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Sistematika Peneltian	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	7
2.1 Profil Variabel dan Teori Dasar	7
2.1.1 <i>Return</i> saham	7
2.1.2 Teori efisiensi pasar	7
2.1.3 Anomali pasar.....	9
2.1.4 Efek pra-liburan.....	10
2.1.5 Efek pasca-liburan	11
2.2 Penelitian Terlebih Dahulu	12
2.3 Pengembangan Hipotesis	14
2.3.1 Hipotesis 1	14
2.3.2 Hipotesis 2	15
2.3.3 Hipotesis 3	16
2.3.4 Hipotesis 4	17
BAB III METODE PENELITIAN.....	18
3.1 Populasi dan Sampel.....	18



3.2 Definisi Operasional	19
3.2.1 Variabel dependen	19
3.2.2 Variabel independen	20
3.2.3 Variabel moderasi	21
3.3 Model Penelitian	23
3.3.1 Uji hipotesis 1 dan hipotesis 2	23
3.3.2 Uji hipotesis 3	24
3.3.3 Uji hipotesis 4	25
3.4 Jenis Data dan Uji Asumsi Klasik	27
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	29
4.1 Sampel Penelitian	29
4.2 Pengujian Hipotesis	30
4.2.1 Uji asumsi klasik	30
4.2.2 Deskripsi statistik	31
4.2.3 Uji hipotesis 1 dan hipotesis 2	34
4.2.4 Uji hipotesis 3	36
4.2.5 Uji hipotesis 4	38
4.3 Pembahasan	39
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	44
5.1 Kesimpulan	44
5.2 Keterbatasan	45
5.3 Saran	45
Daftar Pustaka	46
Lampiran	49
