

DAFTAR ISI

JUDUL	
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GRAFIK	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
INTISARI.....	xiv
ABSTRACT.....	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	7
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	8
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1. Landasan Teori	11
2.1.1. Efisiensi pasar.....	11
2.1.2. Pola langkah acak (<i>Random walk</i>).....	13
2.1.3. Pola musiman	15
2.2. Tinjauan Pustaka dan Hipotesis	17
BAB III METODE PENELITIAN.....	20
3.1. Desain Penelitian	20
3.2. Definisi Operasional Variabel.....	21
3.3. Populasi dan Sampel.....	22

3.4.	Teknik Pengumpulan Data.....	24
3.5.	Teknik Analisis Data	24
3.5.1.	Uji Nonparametrik.....	24
3.5.2.	Uji Parametrik	27
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	29
4.1.	Deskripsi Data.....	29
4.2.	Uji Nonparametrik	39
4.2.1.	Uji Tes Runtun (<i>Run Test</i>).....	39
4.2.2.	Uji Autokorelasi (Autocorrelation Function)	42
4.3.	Uji Parametrik.....	45
4.3.1.	Uji Efek Januari	45
BAB V	SIMPULAN DAN SARAN	58
5.1.	Simpulan	58
5.2.	Implikasi	60
5.3.	Keterbatasan Penelitian.....	60
5.4.	Saran Penelitian	61
DAFTAR PUSTAKA.....		62
LAMPIRAN		64