

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERSETUJUAN.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR TABEL.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah.....	10
1.3 Manfaat penelitian	13
1.4 Batasan Penelitian	14
1.5 Sistematika Penulisan.....	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	17
2.1 Landasan Teori	17
2.1.1. Pasar modal.....	17
2.1.2. <i>Return</i> saham	18
2.1.3 Pasar efisien	19
2.1.4. Anomali pasar	20
2.1.5. <i>Monday effect</i> dan penelitian terdahulu	21
2.1.6. Kebijakan dividen dan penelitian sebelumnya	24
2.1.7. Keuangan keperilakuan.....	30
2.1.8. Indeks Harga Saham	30
2.2. Pengembangan Hipotesis.....	33
2.2.1 Hipotesis satu dan hipotesis dua	33
2.2.2. Pengembangan Hipotesis tiga dan empat	34
BAB III METODE PENELITIAN.....	36
3.1 Pengumpulan Data, Populasi dan Sampel	36
3.2. Proses Pengambilan Sampel.....	39
3.2.1. Proses pemilihan sampel perusahaan yang mengumumkan kenaikan dividen	40

3.2.1. Proses pemilihan sampel perusahaan yang mengumumkan penurunan dividen	40
3.3. Definisi Operasional Variabel	41
3.3.1. <i>Return</i> saham	41
3.3.2. Perubahan dividen.....	42
3.3.3. <i>Monday effect</i>	43
3.4. Metode Pengujian Hipotesis.....	44
3.4.1. Metode pengujian hipotesis satu.....	44
3.4.2. Metode pengujian hipotesis dua	45
3.4.3. Metode pengujian hipotesis tiga	47
3.4.4. Metode pengujian hipotesis empat	48
3.4.5. Metode Uji Statistik.....	50
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	53
4.1. Deskripsi Data dan Pengujian Hipotesis	53
4.1.1. Pengujian hipotesis satu.....	53
4.1.2. Pengujian hipotesis dua	55
4.1.3. Pengujian hipotesis tiga	56
4.1.4. Pengujian hipotesis empat	58
4.2. Pembahasan	59
4.2.1. Pembahasan hipotesis satu.....	59
4.2.2. Pembahasan hipotesis dua	62
4.2.3. Pembahasan hipotesis tiga	64
BAB V PENUTUP.....	67
5.1. Kesimpulan.....	67
5.2. Impikasi bagi Investor dan Emiten.....	70
5.2.1. Implikasi bagi investor.....	70
5.2.2. Implikasi bagi emiten.....	70
5.3. Keterbatasan Penelitian	71
5.4. Saran.....	72
DAFTAR PUSTAKA	73

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Deskripsi Data yang digunakan untuk Uji Hipotesis 1	53
Tabel 4.2. Hasil Uji Independent Sampel T-Test.....	54
Tabel 4.3 Deskripsi Data yang digunakan untuk Uji Hipotesis 1	55
Tabel 4.4 Hasil Uji Independent Sampel T-Test.....	56
Tabel 4.5. Deskripsi Data dan Hasil Uji Independent Sampel T-Test <i>Monday effect</i> pada pengumuman dividen naik (<i>dividend increase</i>).....	57