

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	6
1.4. Tujuan Penelitian.....	6
1.5. Manfaat Penelitian.....	6
1.6. Sistematika Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1. Pasar Modal.....	8
2.2. Pasar Efisien.....	9
2.3. <i>Behavioral Finance</i>	11
2.4. Anomali Pasar	12
2.5. <i>January Effect</i>	16
2.6. Hipotesis	17
BAB III METODE PENELITIAN	21
3.1. Sampel dan Data	21
3.2. Variabel Penelitian	22
3.3. Proses Pengujian Hipotesis	23
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	26
4.1. Statistik Deskriptif <i>January Effect</i>	26
4.1.1. Statistik Deskriptif <i>January Effect</i> untuk Semua Saham.....	26

4.1.2. Statistik Deskriptif <i>January Effect</i> untuk Saham Berkapitalisasi Besar	27
4.1.3. Statistik Deskriptif <i>January Effect</i> untuk Saham Berkapitalisasi Kecil.....	28
4.2. Uji Normalitas.....	29
4.2.1. Uji Normalitas untuk Semua Saham.....	30
4.2.2. Uji Normalitas untuk Saham Berkapitalisasi Besar.....	30
4.2.3. Uji Normalitas untuk Saham Berkapitalisasi Kecil	31
4.3. Hasil Pengujian Hipotesis Pertama	31
4.3.1. Hasil Pengujian <i>January Effect</i> untuk Semua Saham.....	31
4.3.2. Pembahasan Hipotesis Pertama	32
4.4. Hasil Pengujian Hipotesis Kedua	33
4.3.1. Hasil Pengujian <i>January Effect</i> untuk Saham Berkapitalisasi Besar	33
4.3.2. Hasil Pengujian <i>January Effect</i> untuk Saham Berkapitalisasi Kecil	34
4.3.3. Pembahasan Hipotesis Kedua	35
BAB V PENUTUP	38
5.1. Kesimpulan.....	38
5.2. Implikasi Penelitian.....	38
5.3. Keterbatasan Penelitian	39
5.1. Saran	39
DAFTAR PUSTAKA	41
LAMPIRAN.....	44

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Statistik Deskriptif Semua Saham periode 2013-2017	26
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif Saham Berkapitalisasi Besar periode 2013-2017	27
Tabel 4.3	Statistik Deskriptif Saham Berkapitalisasi Kecil periode 2013-2017	29
Tabel 4.4	Hasil Uji Normalitas untuk Semua Saham 2013-2017	30
Tabel 4.5	Hasil Uji Normalitas untuk Saham Berkapitalisasi Besar 2013-2017	30
Tabel 4.6	Hasil Uji Normalitas untuk Saham Berkapitalisasi Kecil 2013-2017	31
Tabel 4.7	Hasil Model Regresi untuk Semua Saham 2013-2017	31
Tabel 4.8	Hasil Model Regresi untuk Saham Berkapitalisasi Besar 2013-2017	33
Tabel 4.9	Hasil Model Regresi untuk Saham Berkapitalisasi Kecil 2013-2017	34

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.	Daftar Perusahaan Penelitian.....	44
Lampiran 2.	<i>Return</i> Bulanan Saham Perusahaan.....	46
Lampiran 3.	Uji Normalitas pada Saham periode 2013-2017.....	60
Lampiran 4.	Hasil Regresi pada Saham periode 2013-2017.....	63