

## DAFTAR ISI

Lembar Judul.....	i
Lembar Pengesahan .....	ii
Lembar Pernyataan .....	iii
Kata Pengantar .....	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel .....	ix
Daftar Gambar .....	x
Abstrak .....	xi
Abstract .....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
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
<b>BAB II LANDASAN TEORI.....</b>	<b>13</b>
2.1 Teori Capital Asset Pricing Model (CAPM).....	13

2.2 Teori Efisiensi Pasar .....	13
2.3 Indeks Saham Gabungan Sektoral.....	15
2.4 Anomali Kalender .....	16
2.5 Anomali Bulan Ramadan .....	19
2.6 Studi Peristiwa .....	20
2.7 <i>Abnormal Return</i> .....	22
2.8 Kajian Penelitian Terdahulu .....	26
2.9 Perumusan Hipotesis .....	32
<b>BAB III METODA PENELITIAN .....</b>	<b>38</b>
3.1 Jenis Dan Sumber Data .....	38
3.2 Periode Pengamatan Data .....	39
3.3 Metoda Analisis Data .....	45
3.4 Desain Penelitian .....	46
3.5 Defenisi Operasional Variabel .....	47
3.6 Pengujian Hipotesis .....	50
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>52</b>
4.1 Deskripsi Data .....	52
4.2 Deskripsi Statistik .....	53
4.3 Pengujian Hipotesis .....	57
4.4 Pembahasan .....	61

4.5 Implikasi .....	64
<b>BAB V SIMPULAN .....</b>	<b>66</b>
5.1 Simpulan .....	66
5.2 Keterbatasan Penelitian .....	67
5.3 Saran .....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>69</b>
<b>LAMPIRAN</b>	

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Kinerja Indeks Sektoral pada Bulan Ramadan Periode 2006 s/d 2016.....	3
Tabel 1.2 Indeks Pertumbuhan Bulanan .....	5
Tabel 2.1 Penetapan Sektor BEI per Maret 2016.....	16
Tabel 2.2 Klasifikasi Anomali Pasar.....	18
Tabel 2.3 Ringkasan Hasil Penelitian Terdahulu .....	31
Tabel 3.1 Daftar Subsektor Emiten Industri Barang Konsumsi 2013 s/d 2017 .....	39
Tabel 3.2 Tanggal Peristiwa Ramadan di Indonesia 2013-2017.....	40
Tabel 4.1 Jumlah Sampel Penelitian .....	52
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif .....	53
Tabel 4.3 Hasil Uji One Sample T-Test.....	58
Tabel 4.4 Hasil Uji Paired Sample T-Test .....	59
Tabel 4.5 Hasil Uji Normalitas Data.....	61

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Periode Estimasi dan Periode Jendela.....	24
Gambar 3.1 Model Periode Estimasi dan Peristiwa Penelitian.....	41
Gambar 3.2 Periode Estimasi dan Periode Peristiwa Ramadan Tahun 2013.....	42
Gambar 3.3 Periode Estimasi dan Periode Peristiwa Ramadan Tahun 2014.....	43
Gambar 3.4 Periode Estimasi dan Periode Peristiwa Ramadan Tahun 2015.....	43
Gambar 3.5 Periode Estimasi dan Periode Peristiwa Ramadan Tahun 2016.....	44
Gambar 3.6 Periode Estimasi dan Periode Peristiwa Ramadan Tahun 2017.....	45
Gambar 4.1 Pergerakan <i>Average Abnormal Return</i> 2013 s/d 2017 H+7 & H-7 .....	63