



DAFTAR ISI

	Halaman
KATA PENGANTAR.....	i
DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR LAMPIRAN	v
INTISARI.....	vi
ABTRACT	vii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	6
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
1.5. Batasan Penelitian	8
1.6. Struktur Penelitian.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESA	10
2.1. Tinjauan Pustaka	10
2.2. Variabel Penelitian	13
2.3. Hubungan Efek Hari Libur dengan Tingkat Pengembalian Saham	19
2.4. Penelitian Terdahulu.....	23
2.5. <i>Size Effect</i>	26
2.6. <i>State Holidays dan Cultural Holidays</i>	28
BAB III METODE PENELITIAN.....	30
3.1 Periode, Populasi, dan Sampel Penelitian.....	30
3.2 Data dan Sumber Data	31
3.3 Definisi Operasional dan Pengukuran	31
3.4 Prosedur Pengelompokan Data.....	35
3.4.1 Pengelompokan Sampel Berdasarkan Hari	35



Halaman

3.4.2 Pengelompokan Sampel Berdasarkan Ukuran Kapitalisasi pasar.....	35
3.5 Pengujian Hipotesa	35
3.5.1 Pengujian Statistik	35
3.5.2 Pengujian Hipotesa 1	37
3.5.3 Pengujian Hipotesa 2	38
3.5.4 pengujian Hipotesa 3	39
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	41
4.1 Pengaruh Hari Libur di Bursa Efek Indonesia.....	41
4.1.1 Pengujian Efek Sebelum Hari Libur.....	41
4.1.2 Pengujian Efek Setelah Hari libur	44
4.2 Ukuran Kapitalisasi Saham dan pengaruh Hari Libur.....	45
4.2.1 Pengujian Efek Sebelum Hari Libur.....	45
4.2.2 Pengujian Efek Setelah Hari libur	46
4.3 Pengaruh Hari Libur dan Anomali Pasar.....	47
4.3.1 Pengujian Efek Sebelum Hari Libur.....	47
4.3.2 Pengujian Efek Setelah Hari libur	49
4.4 Uji Normalitas	51
BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN, DAN SARAN	53
5.1 Kesimpulan Penelitian	53
5.2 Keterbatasan dan Saran	54
DAFTAR PUSTAKA.....	55
LAMPIRAN	57