

## DAFTAR ISI

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| HALAMAN JUDUL .....                   | i    |
| HALAMAN PENGESAHAN .....              | ii   |
| HALAMAN PERSETUJUAN .....             | iii  |
| HALAMAN KEASLIAN KARYA TULIS .....    | iv   |
| KATA PENGANTAR .....                  | iii  |
| DAFTAR ISI .....                      | viii |
| DAFTAR TABEL .....                    | x    |
| DAFTAR LAMPIRAN .....                 | xi   |
| INTISARI .....                        | xii  |
| <i>ABSTRACT</i> .....                 | xiii |
| BAB I PENDAHULUAN .....               | 1    |
| 1.1 Latar Belakang .....              | 1    |
| 1.2 Rumusan Masalah .....             | 4    |
| 1.3 Tujuan Penelitian .....           | 5    |
| 1.4 Manfaat Penelitian .....          | 5    |
| 1.5 Sistematika Penulisan .....       | 6    |
| BAB II LANDASAN TEORI .....           | 7    |
| 2.1 Pasar Modal .....                 | 7    |
| 2.2 Indeks Sektoral .....             | 8    |
| 2.3 Efisiensi Pasar .....             | 8    |
| 2.4 Anomali Pasar .....               | 9    |
| 2.5 Penelitian Terdahulu .....        | 11   |
| 2.6 Hipotesis Penelitian .....        | 12   |
| BAB III METODE PENELITIAN .....       | 14   |
| 3.1 Desain Sampel .....               | 14   |
| 3.2 Metode Pengumpulan Data .....     | 15   |
| 3.3 Definisi Operasional .....        | 15   |
| 3.4 Pengujian Hipotesis Pertama ..... | 16   |
| 3.5 Pengujian Hipotesis Kedua .....   | 19   |

|                                               |        |
|-----------------------------------------------|--------|
| BAB IV ANALISIS HASIL PENELITIAN .....        | 21     |
| 4.1 Statistik Deskriptif .....                | 21     |
| 4.2 Uji Normalitas .....                      | 31     |
| 4.3 Pengujian Hipotesis .....                 | 37     |
| 4.3.1 Hasil Pengujian Hipotesis Pertama ..... | 37     |
| 4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis Kedua .....   | 43     |
| 4.4 Pembahasan .....                          | 45     |
| 4.4.1 Pembahasan Hipotesis Pertama .....      | 45     |
| 4.4.2 Pembahasan Hipotesis Kedua .....        | 48     |
| <br>BAB V PENUTUP .....                       | <br>50 |
| 5.1 Simpulan .....                            | 50     |
| 5.2 Keterbatasan Penelitian .....             | 51     |
| 5.3 Saran .....                               | 52     |
| <br>DAFTAR PUSTAKA .....                      | <br>53 |
| <br>LAMPIRAN .....                            | <br>55 |