

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL.....	xi
ABSTRAK	xii
BAB I.....	13
PENDAHULUAN	13
1.1. Latar Belakang.....	13
1.2. Rumusan Masalah.....	21
1.3. Tujuan Penelitian	21
1.4. Manfaat Penelitian	21
1.5. Sistematika Penelitian.....	22
BAB II.....	24
TINJAUAN PUSTAKA.....	24
2.1. Indeks Sektoral	24
2.2. Efisiensi Pasar Secara Informasi	25
2.2.1. Efisiensi Pasar Bentuk Lemah	29
2.2.2. Efisiensi Pasar Bentuk Setengah Kuat	30
2.2.3. Efisiensi Pasar Bentuk Kuat	32
2.3. Anomali Pasar	33
2.4. <i>Ramadhan Effect</i>	34
2.5. <i>Abnormal Return</i>	36
2.5.1. <i>Mean Adjusted Model</i>	38
2.5.2. <i>Market Model</i>	39
2.5.3. <i>Market Adjusted Model</i>	39
2.6. Penelitian Terdahulu	40

2.7.	Pengembangan Hipotesis	43
BAB III.....		44
METODE PENELITIAN		44
3.1.	Data dan Sampel	44
3.2.	Defini Operasional Variabel.....	46
3.3.	Teknik Analisis	47
3.3.1.	Uji Normalitas	47
3.3.2.	<i>Paired Sample t-Test</i>	49
BAB IV		52
PEMBAHASAN.....		52
4.1.	Hasil Uji	53
4.1.1.	Uji Normalitas	53
4.1.2.	<i>Paired Sample t-Test</i>	54
4.2.	Pembahasan.....	62
BAB V.....		70
PENUTUP		70
5.1.	Kesimpulan.....	70
5.2.	Saran	71
DAFTAR PUSTAKA		72
LAMPIRAN I		75
LAMPIRAN II.....		93

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1	17
Gambar 2.1	27
Gambar 2.2	43

DAFTAR TABEL

Tabel 3	45
Tabel 4.1	52
Tabel 4.2	54
Tabel 4.3	55
Tabel 4.4	56
Tabel 4.5	56
Tabel 4.6	57
Tabel 4.7	58
Tabel 4.8	59
Tabel 4.9	60
Tabel 4.10	61