

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI.....	iv
KATA PENGANTAR	v
PERSEMBAHAN.....	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
ABSTRAKSI	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Sistematika Penulisan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 <i>Return</i>	8
2.1.2 Konsep Pasar Efisien.....	9
2.1.3 Anomali Pasar	12
2.2 Penelitian Terdahulu	18
2.3 Pengembangan Hipotesis	24
BAB IV METODA PENELITIAN	26
3.1 Populasi Penelitian.....	26
3.2 Data dan Sumber Data	26
3.3 Metode Pengumpulan Data	27
3.4 Definisi Operasional Variabel.....	27
3.5 Metode Penelitian	28



3.6 Metode Analisis Statistik	29
3.6.1 Uji Hipotesis	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	37
4.1 Statistik Deskriptif	37
4.1.1 <i>January Effect</i>	37
4.1.2 <i>Day of the Week Effect</i>	41
4.1.3 <i>TOM Effect</i>	44
4.2 Uji Asumsi	46
4.2.1 Uji Normalitas.....	46
4.2.2 Uji Homogenitas	49
4.3 Hasil Analisis Data	51
4.3.1 <i>January Effect</i>	51
4.3.2 <i>Day of The Week Effect</i>	53
4.1.3 <i>TOM Effect</i>	55
4.4 Pembahasan	57
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	60
5.1 Kesimpulan	60
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	61
5.3 Saran	61
Daftar Pustaka.....	62
LAMPIRAN	66