

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang.....	1
B. Perumusan Masalah.....	5
C. Tujuan Penelitian.....	6
D. Pembatasan Masalah.....	7
E. Manfaat Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
A. Perkembangan Bursa Efek Indonesia.....	9
B. Indeks Harga Saham.....	11

1. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	11
2. Indeks Sektoral.....	12
3. Indeks LQ45.....	13
4. Jakarta Islamic Index (JII).....	14
5. Indeks Kompas 100.....	14
6. Indeks BISNIS-27.....	15
7. Indeks PEFINDO25.....	15
8. Indeks SRI-KEHATI.....	15
9. Indeks Papan Utama (MBX) dan Indeks Papan Pengembangan (DBX).....	16
10. Indeks Individual.....	16
C. Pengertian <i>Bullish</i> dan <i>Bearish</i>	16
D. Teori Efisiensi Pasar.....	18
E. Teori Perilaku Keuangan.....	22
F. Anomali Pasar dan Penelitian-penelitian Sebelumnya.....	23
G. Kerangka Pemikiran dan Hipotesis.....	30
BAB III METODA PENELITIAN	
A. Data.....	32
B. Pengolahan data untuk pengujian <i>day of the week effect</i>	33

C. Pengolahan data untuk meneliti kecenderungan pergerakan	
IHSG dan Indeks Sektoral.....	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Pengujian <i>day of the week effect</i>	36
1. ANOVA.....	38
2. Uji Kruskal-Wallis, dan Uji Mann-Whitney.....	40
B. Penelitian Kecenderungan Pergerakan IHSG.....	43
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	48
B. Saran.....	50
DAFTAR PUSTAKA.....	53

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Hasil pengujian statistik pra-syarat ANOVA.....	36
Tabel 4.2	Hasil pengujian ulang statistik pra-syarat ANOVA (setelah data ekstrim dikeluarkan).....	37
Tabel 4.3	Hasil ANOVA dan Uji Lanjutannya.....	38
Tabel 4.4	Uji Kruskal-Wallis, dan Uji Mann-Whitney.....	41
Tabel 4.5	Kecenderungan Pergerakan IHSG.....	43
Tabel 4.6	<i>Bullish</i> dan <i>Bearish</i> Bulanan (IHSG).....	45
Tabel 4.7	<i>Bullish</i> dan <i>Bearish</i> per Semester (IHSG).....	46

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Kerangka Pemikiran.....	30
------------	-------------------------	----