

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
PERSETUJUAN AKADEMIS	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Rumusan Masalah	9
1.4 Tujuan Penelitian	9
1.5 Kegunaan Penelitian.....	9
1. 5. 1 Aspek Teoritis	9
1.5. 2 Aspek Praktis	10
1.6 Sistematika Penulisan	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	12
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	12
2.1.1 Investasi.....	12
2.1.2 Pasar Modal.....	13

2.1.3	Indeks Pasar Saham.....	15
2. 1. 3. 1	Pengertian Indeks Saham	15
2. 1. 3. 2	Macam-macam Indeks Harga Saham.....	15
2.1.4	Pasar Efisien.....	17
2.1.5	Anomali Pasar	20
2.1.6	Saham.....	24
2.1.7	Imbal Hasil (Return)	25
2.2	Penelitian Terdahulu	26
2.3	Kerangka Penelitian	29
2.4	Hipotesis Penelitian.....	32
2.5	Ruang Lingkup Penelitian.....	32
2. 5. 1	Variabel Penelitian	32
2. 5. 2	Objek Penelitian	32
2. 5. 3	Waktu dan Periode Penelitian	32
BAB III	METODE PENELITIAN	33
3.1	Jenis Penelitian.....	33
3.2	Variabel Operasional.....	33
3. 2. 1	Variabel	33
3.3	Tahapan Penelitian	36
3. 3. 1	Efek Hari Perdagangan	38
3. 3. 2	Efek Minggu Keempat	38
3.4	Populasi dan Sampel	39
3.5	Pengumpulan Data	41
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	42

	3. 6. 1 Uji ANOVA (<i>Analysis of Variance</i>)	42
	3. 6. 2 Uji T Berpasangan (<i>Paired Sample T-Test</i>)	42
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	44
4.1	Deskripsi Variabel Penelitian.....	44
4.1.1	Deskripsi <i>Return</i> Saham DoW	44
4.1.2	Deskripsi <i>Return</i> Saham <i>Week-four Effect</i>	47
4.2	Analisis Data	48
4. 2. 1	Uji Normalitas	48
4. 2. 2	Uji Homogenitas	49
4. 2. 3	Uji ANOVA	49
4. 2. 4	Uji Paired Sample T-Test.....	50
4.3	Pembahasan.....	51
4. 3. 1	Efek Hari Perdagangan di LQ45	51
4. 3. 2	Efek Minggu Keempat di LQ45.....	52
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	53
5.1	Kesimpulan	53
5.2	Saran.....	53
5. 2. 1	Aspek Teoritis	53
5. 2. 2	Aspek Praktis	54
DAFTAR PUSTAKA		56