

## DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK .....	vi
<i>ABSTRACT</i> .....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL .....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
BAB I.....	1
1.1    Gambaran Umum Objek Penelitian .....	1
1.2    Latar Belakang Penelitian .....	2
1.3    Perumusan Masalah .....	8
1.4    Tujuan Penelitian .....	9
1.5    Manfaat Penelitian .....	9
1.5.1    Aspek Teoristis .....	9
1.5.2    Aspek Praktis.....	10
1.6    Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	10
BAB II.....	12
2.1    Teori dan Penelitian Terdahulu .....	12
2.1.1    Teori Sinyal.....	12
2.1.2    Pasar Modal.....	12
2.1.3    Investasi.....	13
2.1.4    Hipotesis Pasar Efisien.....	13
2.1.5    Saham.....	14
2.1.6    Return Saham .....	15
2.1.7    Anomali Pasar .....	15
2.1.8    Penelitian Terdahulu .....	19
2.2    Kerangka Pemikiran.....	32
2.3    Hipotesis Penelitian .....	33
BAB III.....	34

3.1	Jenis Penelitian .....	34
3.3	Tahapan Penelitian.....	36
3.4	Populasi dan Sampel .....	39
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data .....	41
3.6	Teknik Analisis Data .....	42
<b>BAB IV .....</b>		<b>46</b>
4.1.	Hasil Penelitian.....	46
4.1.1.	Statistik Deskriptif .....	46
4.1.2.	<i>Monday Effect</i> .....	50
4.1.3.	<i>Rogalski Effect</i> .....	53
4.2.	Pembahasan Hasil Penelitian .....	56
4.2.1.	<i>Monday Effect</i> .....	56
4.2.2.	<i>Rogalski Effect</i> .....	57
<b>BAB V .....</b>		<b>60</b>
5.1	Kesimpulan.....	60
5.2.	Saran .....	61
5.2.1.	Aspek Teoritis.....	61
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>		<b>62</b>