

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kehadiran Allah SWT atas limpahan rahmat, karunia dan hidayah-Nya yang diberikan sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini yang berjudul “**Analisis Perbedaan Return Saham Sebelum dan Sesudah Hari Libur Pada Indeks Kompas 100**”. Penulisan tugas akhir ini sebagai salah satu syarat kelulusan program strata satu pada Program Studi Akuntansi Institut Manajemen Telkom.

Dalam penelitian ini, penulis telah banyak mendapatkan bimbingan, kritik, saran, dan motivasi yang sangat besar dari berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis mengucapkan terima kasih sebesar-besarnya kepada :

1. Mamah (Suwarni) dan Papah (Husen Sendratna), A Deni, Teh Dessi, Tante Yanti, A Lukman, Teh Rena serta keluarga yang penulis sayangi untuk semua kasih sayang, motivasi dan doa yang tiada henti dipanjatkan kepada penulis.
2. Bapak Prof. Dr. Hiro Tugiman, Drs, Ak, QIA, CRMP selaku Ketua Program Studi S-1 Akuntansi Institut Manajemen Telkom
3. Bapak Deannes Isynuwardhana, SE., MM. selaku Dosen Pembimbing Institut Manajemen Telkom yang telah banyak membantu, membimbing, memotivasi dan memberikan saran kepada penulis dalam penulisan skripsi ini.
4. Seluruh Bapak dan Ibu dosen Institut Manajemen Telkom dan staf Prodi Akuntansi yang telah memberikan ilmu yang sangat bermanfaat kepada penulis.
5. Sahabat sekaligus saudara seperjuangan, tempat berbagi canda, tawa, suka, dan duka selama perkuliahan. Ayu, Diza, Lady belajar bareng sukses bareng ya!! ☺

6. Teman-teman Akuntansi 2009 terutama Akuntansi B terima kasih atas dukungan, semangat, dan bantuannya selama ini.
7. Teman-teman Sailors (Tri, Fitra, Ari, Osy, Fathia, Upay, Tatika), Irma yang sama-sama berjuang di kampus masing-masing untuk sukses bersama-sama.
8. Rekan-rekan seperjuangan yang sama-sama berusaha untuk menyelesaikan skripsi. Terima kasih atas bantuan dan masukan selama pembuatan skripsi.
9. Semua pihak dengan tidak mengurangi rasa hormat tidak dapat penulis sebutkan satu per satu yang telah memberikan dukungan semangat dalam menyelesaikan laporan magang ini.

Penulis menyadari bahwa penulisan tugas akhir ini masih jauh dari kesempurnaan. Dengan segenap kerendahan hati, penulis berharap semoga segala kekurangan yang ada pada skripsi ini dapat dijadikan bahan pembelajaran untuk penelitian yang lebih baik dimasa yang akan datang.

Bandung, Maret 2013

Penulis

Desti Huswaeni

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
ABSTRAK.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.1.1 Karakteristik Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian.....	2
1.3 Perumusan Masalah.....	8
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Kegunaan Penelitian.....	9
1.5.1 Aspek Teoritis.....	9
1.5.2 Aspek Praktis.....	9
1.6 Sistematika Penelitian.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....	11
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian.....	11
2.1.1 Rangkuman Teori.....	11
A. Pengertian Investasi.....	11
B. Pasar Modal.....	11
C. Saham.....	13
D. Pasar Efisien.....	16

E. <i>Behavioral Finance</i>	17
F. Anomali Pasar	18
2.1.2. Penelitian Terdahulu	24
2.2 Kerangka Pemikiran	31
2.3 Hipotesis Penelitian	35
2.4 Ruang Lingkup Penelitian	35
BAB III METODE PENELITIAN	36
3.1 Jenis Penelitian	36
3.2. Variabel Operasional	36
3.3. Tahapan Penelitian	38
3.4 Populasi dan Sampel.....	40
3.5 Pengumpulan Data.....	41
3.6 Teknik Analisi Data.....	42
3.6.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	42
3.6.2 Uji Normalitas Data	42
3.6.3 Uji Hipotesis	43
A. Uji Statistik Parametrik	43
B. Uji Non-Parametrik	45
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	48
4.1 Hasil Penelitian.....	48
4.1.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	48
4.1.2 Pengujian Normalitas Data	55
4.1.3 Pengujian Hipotesis	57
4.2 Pembahasan Hasil Penelitian.....	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	66
5.1 Kesimpulan.....	66
5.2 Saran.....	67
DAFTAR PUSTAKA	69