

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Perumusan Masalah.....	6
1.4 Pertanyaan Penelitian	7
1.5 Tujuan Penelitian.....	7
1.6 Manfaat Penelitian.....	7
1.6.1 Aspek Teoritis	7
1.6.2 Aspek Praktis	7
1.7 Ruang Lingkup Penelitian	8
1.7.1 Lokasi dan Objek Penelitian	8
1.7.2 Waktu dan Periode Penelitian	8
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	8
BAB II	11
TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 Saham.....	11
2.1.2 Return Saham	12
2.1.3 Efisiensi Pasar	13
2.1.4 Anomali Pasar	14

2.1.5	<i>January Effect</i>	16
2.2	Penelitian Terdahulu.....	17
2.3	Kerangka Pemikiran	21
2.4	Hipotesis Penelitian	23
BAB III	24
METODE PENELITIAN	24
3.1	Karakteristik Penelitian	24
3.2	Variabel Operasional	25
3.2.1	Variabel Independen	25
3.3	Tahapan Penelitian	26
3.4	Populasi dan Sampel	27
3.4.1	Populasi.....	27
3.4.2	Sampel	28
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	28
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	29
3.6.1	Analisis Statistik Deskriptif	29
3.6.2	Pengujian Hipotesis	29
3.6.2.1	Uji Normalitas.....	29
3.6.2.2	Uji Homogenitas	29
3.6.2.3	Uji <i>One Way ANOVA</i>	30
BAB IV	32
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	32
4.1	Karakteristik Responden	32
4.2	Hasil Penelitian.....	33
4.2.1	Analisa Deskriptif	33
4.2.2	Hasil Pengujian Hipotesis	34
4.2.2.1	Uji Normalitas.....	34
4.2.2.2	Uji Homogenitas	34
4.2.2.3	Uji <i>One Way ANOVA</i>	35
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian.....	35
BAB V	38
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	38

5.1	Kesimpulan.....	38
5.2	Saran.....	38
5.2.1	Aspek Teoritis.....	38
5.2.2	Aspek Praktis	38
	DAFTAR PUSTAKA	40
	LAMPIRAN.....	42