

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	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
BAB IV		46
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
BAB V		60
5.1	Kesimpulan.....	60
5.2.	Saran	61
5.2.1.	Aspek Teoritis.....	61
DAFTAR PUSTAKA.....		62