

## DAFTAR ISI

	Hal
Halaman Depan.....	i
Halaman Judul .....	ii
Halaman Persetujuan Pembimbing .....	iii
Halaman Pengesahan .....	iv
Halaman Motto dan Persembahan .....	v
Pernyataan Keaslian Karya.....	vi
Abstraksi.....	vii
Kata Pengantar.....	ix
Daftar Isi.....	xi
Daftar Tabel.....	xiii
Daftar Gambar .....	xiv
<b>Bab 1: pendahuluan .....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang .....	1
B. Perumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian .....	8
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	9
<b>Bab II: Landasan Teori .....</b>	<b>11</b>
A. Hipotesis Pasar Efisien .....	11
B. Anomali Pasar .....	13
C. Saham.....	16
D. Pengertian Pasar Modal .....	18
E. <i>Return</i> .....	20
F. <i>Abnormal Return</i> .....	22
G. <i>Expected Return</i> .....	24
H. Penelitian Terdahulu .....	26
I. Kerangka Teoritis.....	30
J. Pengembangan Hipotesis .....	30
<b>Bab III: Metode Penelitian .....</b>	<b>33</b>

A. Jenis Penelitian .....	33
B. Ukuran Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel.....	33
C. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	34
D. Teknik Pengumpulan Data.....	35
E. Variabel dan Pengukurannya.....	35
F. Teknik Analisis Data .....	39
1. Statistik Deskriptif .....	39
2. Uji Asumsi Klasik.....	39
3. Pengujian Hipotesis .....	41
<b>Bab IV: Hasil dan Pembahasan.....</b>	<b>44</b>
A. Hasil Pengumpulan Data Penelitian .....	44
B. Statistik Deskriptif dan Uji Asumsi Klasik .....	45
1. Statistik Deskriptif .....	45
2. Uji Asumsi Klasik.....	46
C. Hasil Analisis Data .....	49
1. Pengujian Regresi .....	49
2. Pengujian Non Parametrik .....	52
D. Pembahasan Hasil Penelitian .....	52
E. Implikasi .....	55
<b>Bab V: Simpulan, Keterbatasan dan Saran .....</b>	<b>57</b>
A. Simpulan .....	57
B. Keterbatasan dan Saran .....	58

#### **Daftar Pustaka**

#### **Lampiran**

## DAFTAR TABEL

	<b>Hal</b>
Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu .....	27
Tabel 4.1 Perincian Daftar Sampel .....	44
Tabel 4.2 Uji Statistik Deskriptif Sebelum Terpenuhi Asumsi Klasik.....	45
Tabel 4.3 Uji Statistik Deskriptif Sesudah Terpenuhi Asumsi Klasik .....	46
Tabel 4.4 Uji <i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i> .....	47
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas.....	47
Tabel 4.6 Uji <i>Park</i> .....	48
Tabel 4.7 Uji <i>Run Test</i> .....	49
Tabel 4.8 Hasil Regresi Linier dengan <i>Dummy</i> .....	50
Tabel 4.9 Uji Non Parametrik <i>McNemar</i> .....	52

## DAFTAR GAMBAR

	<b>Hal</b>
Gambar 2.1 Diagram Aliran Dana dan Efek pada Pasar Modal .....	18
Gambar 2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis Hipotesis 1 .....	30
Gambar 2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis Hipotesis 2.....	30