

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	I
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	II
HALAMAN PENGESAHAN	III
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	IV
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA	V
PERSETUJUAN UNGGAH SKRIPSI.....	VI
ABSTRAKSI INDONESIA	VII
ABSTRAKSI INGGRIS	VIII
KATA PENGANTAR.....	IX
DAFTAR ISI.....	XI
DAFTAR GAMBAR.....	XIII
DAFTAR GRAFIK.....	XIV
DAFTAR TABEL	XV
LAMIRAN	XVI

Bab 1: pendahuluan	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Perumusan Masalah	4
C. Tujuan Penelitian	5
D. Manfaat Penelitian	5
E. Sistematika Penulisan	5
Bab II: Landasan Teori	7
A. Pasar Modal	7
B. Saham	8
C. Hipotesis Pasar Efisien	9
D. Pengertian Pasar Modal	10
E. Bentuk Pasar Efisien.....	11
F. Anomali Pasar.....	13
G. January Effect	14
H. Return Saham.....	15
I. Indeks LQ 45	15
J. Penelitian Terdahulu	16

K. Hipotesis dan Pengembangannya	18
L. Kerangka Pemikiran Teoritis	19
Bab III: Metode Penelitian	20
A. Jenis Penelitian	20
B. Populasi dan Sampel.....	20
C. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	21
D. Metode Pengumpulan Data.....	21
E. Variabel dan Pengukurannya	22
F. Teknik Analisis Data	23
1. Statistik Deskriptif	23
2. Uji Asumsi Klasik.....	23
3. Analisis Regresi <i>With Dummy</i>	26
Bab IV: Hasil dan Pembahasan	27
A. Hasil Pengumpulan Data Penelitian	27
B. Statistik Deskriptif dan Uji Asumsi Klasik	28
1. Statistik Deskriptif	28
2. Uji Asumsi Klasik.....	29
C. Hasil Analisis Data	32
1. Pengujian Regresi	32
2. Pembahasan.....	35
Bab V: Simpulan, Keterbatasan dan Saran	39
A. Simpulan	39
B. Implikasi	39
C. Keterbatasan dan Saran.....	40
Daftar Pustaka	
Lampiran	

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Struktur Pasar Modal Indonesia	7
Gambar 2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis	19

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 <i>Return Rata-Rata</i> Saham Perbulan LQ 45 Periode 2010-201329
Grafik 4.2 Total <i>Return Rata-Rata</i> Perbulan Perusahaan LQ 45 2010-201335

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	17
Tabel 4.1 Perincian Daftar Sampel	27
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif <i>Return</i> Rata-Rata Perbulan	28
Tabel 4.3 Uji <i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test</i>	30
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas	30
Tabel 4.5 Hasil Pengujian Heterokedastisitas Uji Gleser	31
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi <i>Run Test</i>	32
Tabel 4.7 Hasil Uji ANOVA.....	33
Tabel 4.8 Hasil Regresi Linier dengan <i>Dummy</i>	33
Tabel 4.9 <i>Return Bulanan Saham LQ 45</i>	35

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Daftar Sampel

Lampiran 2. Data Sampel

Lampiran 3. Hasil Uji Statistik Deskriptif

Lampiran 4. Hasil Uji Normalitas

Lampiran 5. Hasil Uji Multikolinearitas

Lampiran 6. Hasil Uji Heterokedastisitas

Lampiran 7. Hasil Uji Autokorelasi

Lampiran 8. Hasil Uji Regresi Linier Berganda dengan *Dummy*