

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME	iii
HALAMAN PERSETUJUAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xi
ABSTRAK	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I: PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	9
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	10
1.5 Sistematika Penulisan	10
BAB II: KAJIAN PUSTAKA	12
2.1 Landasan Teori	12
2.1.1 Pasar Modal.....	12
2.1.2 Anomali Pasar	17
2.1.3 <i>January Effect</i>	20
2.1.4 <i>Ramadhan Effect</i>	21
2.1.5 <i>Imlek Effect</i>	22
2.1.6 <i>Event Study</i>	24

2.1.7 <i>Return Saham</i>	25
2.1.8 <i>Trading Volume Activity</i>	27
2.2 Penelitian Terdahulu	28
2.3 Kerangka Teoritis	30
2.4 Hipotesis Penelitian	31
BAB III: METODE PENELITIAN	37
3.1 Populasi Dan Sampel	37
3.2 Data Dan Sumber Data	40
3.3 Variabel Penelitian Dan Pengukurannya	40
3.4 Teknik Analisa Data	41
BAB IV: DATA DAN PEMBAHASAN	43
4.1 Analisis Deskriptif	43
4.2 Pengujian Hipotesis	45
4.2.A Uji Normalitas	45
1.a <i>January Effect</i>	46
1.b <i>Ramadhan Effect</i>	49
1.c <i>Imlek Effect</i>	52
4.2.B Uji <i>Wilcoxon</i>	55
2.a <i>January Effect</i>	56
2.b <i>Ramadhan Effect</i>	61
2.c <i>Imlek Effect</i>	67
4.3 Pembahasan	72
4.3.a <i>January Effect Terhadap Return</i>	73
4.3.b <i>January Effect Terhadap TVA</i>	75
4.3.c <i>Ramadhan Effect Terhadap Return</i>	76

4.3.d Ramadhan <i>Effect</i> Terhadap TVA	77
4.3.e Imlek <i>Effect</i> Terhadap <i>Return</i>	79
4.3.f Imlek <i>Effect</i> Terhadap TVA.....	81
BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN	83
5.1 Kesimpulan	83
5.2 Saran	84
DAFTAR REFERENSI	86
LAMPIRAN	92
Daftar Perusahaan BUMN Publik	92
Daftar Perusahaan Indeks LQ 45	93
Daftar Rata-Rata <i>Return</i> Pada <i>January Effect</i>	94
Daftar Rata-Rata TVA Pada <i>January Effect</i>	96
Daftar Rata-Rata <i>Return</i> Pada Ramadhan <i>Effect</i>	97
Daftar Rata-Rata TVA Pada Ramadhan <i>Effect</i>	99
Daftar Rata-Rata <i>Return</i> Pada Imlek <i>Effect</i>	100
Daftar Rata-Rata TVA Pada Imlek <i>Effect</i>	102
Daftar <i>Return</i> Januari 2016.....	104
Daftar <i>Return</i> Januari 2017.....	106
Daftar <i>Return</i> Januari 2018.....	108
Daftar TVA Januari 2016	110
Daftar TVA Januari 2017	112
Daftar TVA Januari 2018	114
Daftar <i>Return</i> Ramadhan 2016	116
Daftar <i>Return</i> Ramadhan 2017	118

Daftar <i>Return</i> Ramadhan 2018	120
Daftar TVA Ramadhan 2016.....	122
Daftar TVA Ramadhan 2017	124
Daftar TVA Ramadhan 2018.....	126
Daftar <i>Return</i> Imlek 2016.....	128
Daftar <i>Return</i> Imlek 2017	130
Daftar <i>Return</i> Imlek 2018.....	132
Daftar TVA Imlek 2016.....	134
Daftar TVA Imlek 2017.....	136
Daftar TVA Imlek 2018.....	138

DAFTAR TABEL

Tabel II: Bagan kerangka berpikir	31
Tabel IV.1: Daftar Perusahaan	43
Tabel IV.2A.a: Regresi Logistik <i>January effect</i>	46
Tabel IV.2A.b: Analisis Deskriptif <i>January effect</i>	47
Tabel IV.2A.c: Hasil Uji Normalitas <i>January effect</i>	48
Tabel IV.2A.d: Regresi Logistik Ramadhan <i>effect</i>	49
Tabel IV.2A.e: Analisis Deskriptif Ramadhan <i>effect</i>	50
Tabel IV.2A.f: Hasil Uji Normalitas Ramadhan <i>effect</i>	51
Tabel IV.2A.g: Regresi Logistik Imlek <i>effect</i>	52
Tabel IV.2A.h: Analisis Deskriptif Imlek <i>effect</i>	53
Tabel IV.2A.i: Hasil Uji Normalitas Imlek <i>effect</i>	54
Tabel IV.2B.a: Analisis Deskriptif <i>January effect</i>	56
Tabel IV.2B.b: Perbedaan Rangking <i>January effect</i>	58
Tabel IV.2B.c: Hasil Uji <i>Wilcoxon January effect</i>	60
Tabel IV.2B.d: Analisis Deskriptif Ramadhan <i>effect</i>	61
Tabel IV.2B.e: Perbedaan Rangking Ramadhan <i>effect</i>	63
Tabel IV.2B.f: Hasil Uji <i>Wilcoxon Ramadhan effect</i>	65
Tabel IV.2B.g: Analisis Deskriptif Imlek <i>effect</i>	67
Tabel IV.2B.h: Perbedaan Rangking Imlek <i>effect</i>	69
Tabel IV.2B.i: Hasil Uji <i>Wilcoxon Imlek effect</i>	71