

DAFTAR ISI

Halaman Sampul Depan Skripsi.....	i
Halaman Judul Skripsi.....	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Pengesahan Skripsi.....	iv
Halaman Pengesahan Ujian Skripsi.....	v
Abstrak.....	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Isi	xi
Daftar Tabel	xiv
Daftar Lampiran	xv
Bab I Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah Penelitian	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Sistematika Penulisan.....	8
Bab II Kajian Pustaka	
2.1 Pasar Modal.....	10
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	10
2.1.2 Pengertian Bursa Efek	11
2.2 Peranan Pasar Modal	12
2.3 Daya Tarik Pasar Modal.....	13
2.4 Manfaat Pasar Modal.....	14
2.5 Efisiensi Pasar Modal	16

2.5.1	Efisiensi Pasar Secara Informasi	17
2.5.2	Efisiensi Pasar Secara Keputusan	19
2.6	Efisiensi Pasar di Indonesia	24
2.7	Surat Berharga	25
2.8	Saham	26
2.9	Indeks Harga Saham	34
2.9.1	Manfaat IHSG	34
2.9.2	IHSG di BEJ	36
2.9.3	ILQ 45	39
2.10	Anomali Pasar	40
2.11	Hipotesis	41
Bab III Metode Penelitian		45
3.1	Objek Penelitian	45
3.2	Populasi dan Penentuan Sampel Penelitian	45
3.3	Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	45
3.4	Definisi Operasional Variabel Penelitian	46
3.5	Metode Analisis Data	47
3.5.1	Hipotesis pertama	48
3.5.2	Hipotesis kedua	50
Bab IV Analisis dan Pembahasan		
4.1	Sampel	52
4.2	Hasil Analisis Data	53
4.2.1	Statistik Deskriptif	53
4.3	Hasil Uji Hipotesis	55
4.3.1	Uji Pengaruh Efek Akhir Pekan	55
4.3.2	Uji Beda <i>Return</i> Saham	57

Bab V Kesimpulan.....	61
5.1 Kesimpulan	61
5.2 Saran.....	62
Daftar Pustaka	
Lampiran	



DAFTAR TABEL

Tabel

4.1	Statistik Deskriptif Variabel.....	53
4.2	Ringkasan Statistik Regresi Return Saham Harian	55
4.3	Analisis of Variance	58
4.4	LSD Beda Return Saham Harian di BEJ	60



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran

1. Sampel Penelitian Periode Pertama.....	65
2. Sampel Penelitian Periode Kedua	67
3. Harga Penutupan LQ-45 Periode Pertama	69
4. Harga Penutupan LQ-45 Periode Kedua	87
5. <i>Return</i> Harian Saham LQ-45 Periode Pertama	105
6. <i>Return</i> Harian Saham LQ-45 Periode Kedua	120
7. Jumlah <i>Return</i> Saham Setiap Hari Perdagangan	140
8. <i>Return</i> Saham yang di Observasi	142
9. Statistik Deskriptif	145
10. Analisis Regresi	150
11. Analisis Varians	160