

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	ii
Pernyataan Bebas Plagiarisme.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRAK.....	vi
MOTTO.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Manfaat Penelitian.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Pasar Modal Efisien.....	10
2.1.2.1 Konsep Pasar Modal Efisien.....	10
2.1.2.2 Bentuk Pasar Modal Efisien.....	12
2.1.3 Hipotesis Pasar Efisien.....	14
2.1.4 Anomali Pasar.....	14
2.1.5 <i>January Effect</i>	17
2.1.5.1 Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi <i>January Effect</i>	18
2.1.6 <i>Monday Effect</i>	20
2.1.6.1 Teori <i>Behaviore Finance</i>	21
2.1.7 <i>Return Saham</i>	23
2.1.8 Indeks LQ-45.....	24

2.2 Penelitian Terdahulu.....	26
2.3 Pengembangan Hipotesis.....	31
2.3.1 Pengaruh fenomena <i>January Effect</i> terhadap return perusahaan yang terdaftar sebagai indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2018.....	31
2.3.2 Pengaruh fenomena <i>Monday Effect</i> terhadap return perusahaan yang terdaftar sebagai indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2018.....	32
2.4 Kerangka Konsep Penelitian.....	34
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	35
3.1 Populasi dan Sampel.....	35
3.2 Data Penelitian.....	35
3.3 Definisi Operasional Variabel Penelitian.....	36
3.3.1 <i>January Effect</i>	36
3.3.2 <i>Monday Effect</i>	37
3.4 Metode Analisis.....	38
3.4.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	38
3.4.2 Uji Normalitas.....	38
3.4.3 Uji Homogenitas.....	38
3.4.4 Uji Hipotesis.....	39
3.4.4.1 Pengujian Hipotesis 1.....	39
3.4.4.2 Pengujian Hipotesis 2.....	41
BAB IV PEMBAHASAN.....	45
4.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	45
4.1.1 <i>January Effect</i>	46
4.1.2 <i>Monday Effect</i>	47
4.2 Uji Normalitas.....	50
4.2.1 <i>January Effect</i>	51
4.2.2 <i>Monday Effect</i>	52
4.3 Pengujian Hipotesis 1.....	53

4.4 Pengujian Hipotesis 2.....	56
4.5 Pembahasan.....	59
4.5.1 Pengaruh <i>January Effect</i> Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar Sebagai Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2015- 2018.....	59
4.5.2 Pengaruh <i>Monday Effect</i> Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar Sebagai Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2015- 2018.....	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	63
5.1 Kesimpulan.....	63
5.2 Saran.....	63
DAFTAR PUSTAKA	65



DAFTAR TABEL

3.4.4.2	Tabel Analisis Varians (ANOVA).....	44
4.1.1	Tabel Hasil Analisis Statistik Deskriptif <i>January Effect</i>	46
4.1.2.	Tabel Hasil Analisis Statistik Deskriptif <i>Monday Effect</i>	47
4.2.1.	Tabel Uji Kolmogorov-Smirnov <i>January Effect</i>	51
4.2.2.	Tabel Uji Kolmogorov-Smirnov <i>Monday Effect</i>	52
4.3.1	Tabel Uji Homogenitas <i>January Effect</i>	54
4.3.2	Tabel Hasil Pengujian Rata-rata Return <i>January Effect</i> dengan Uji Independent T-Test.....	55
4.4.1	Tabel Uji Homogenitas <i>Monday Effect</i>	56
4.4.2	Tabel Uji Welch dan Brown-Forsythe.....	57
4.4.3	Tabel Hasil Pengujian Rata-rata Return <i>Monday Effect</i> dengan Uji ANOVA.....	58

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1. Daftar Sampel Perusahaan.....	68
LAMPIRAN 2. Kriteria Pemilihan Sampel.....	70
LAMPIRAN 3. Rekapitulasi Return Harian Perusahaan Sampel Tahun 2015.....	71
LAMPIRAN 4. Rekapitulasi Return Harian Perusahaan Sampel Tahun 2016.....	72
LAMPIRAN 5. Rekapitulasi Return Harian Perusahaan Sampel Tahun 2017.....	73
LAMPIRAN 6. Rekapitulasi Return Harian Perusahaan Sampel Tahun 2018.....	74
LAMPIRAN 7. Rekapitulasi Rata-Rata Return Harian Perusahaan Sampel Tahun 2015-2018.....	75
LAMPIRAN 8. Rekapitulasi Return Bulanan Perusahaan Sampel Tahun 2015...	76
LAMPIRAN 9. Rekapitulasi Return Bulanan Perusahaan Sampel Tahun 2016...	79
LAMPIRAN 10. Rekapitulasi Return Bulanan Perusahaan Sampel Tahun 2017.	82
LAMPIRAN 11. Rekapitulasi Return Bulanan Perusahaan Sampel Tahun 2018.	85
LAMPIRAN 12. Rekapitulasi Rata-Rata Return Bulan Januari dan Non Januari Perusahaan Sampel Tahun 2015-2018.....	88
LAMPIRAN 13. Hasil Analisis Deskriptif ANOVA.....	89
LAMPIRAN 14. Hasil Uji Normalitas ANOVA.....	90
LAMPIRAN 15. Hasil Uji Homogenitas ANOVA.....	91
LAMPIRAN 16. Hasil Olah Data Uji ANOVA.....	92
LAMPIRAN 17. Hasil Analisis Deskriptif Independent T-Test.....	93
LAMPIRAN 18. Hasil Uji Normalitas Independent T-Test.....	95
LAMPIRAN 19. Hasil Uji Homogenitas Independent T-Test.....	96
LAMPIRAN 20. Hasil Olah Data Uji Independent T-Test.....	97
LAMPIRAN 21. Hasil Uji Welch Dan Brown-Forsythe.....	98