

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	I
HALAMAN PERNYATAAN.....	II
HALAMAN PERSETUJUAN.....	III
HALAMAN PENGESAHAN.....	IV
RIWAYAT HIDUP.....	V
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	VI
MOTTO.....	VII
ABSTRAC.....	VIII
ABSTRAK.....	IX
KATA PENGANTAR.....	X
DAFTAR LAMPIRAN.....	XI
BAB I	1
PENDAHULUAN	16
1.1 Latar Belakang Masalah	16
1.2 Rumusan Masalah	24
1.3 Batasan Masalah	24
1.4 Ruang lingkup penelitian	25
1.4.1 Ruang Lingkup Subjek	25
1.4.2 Ruang Lingkup Objek	25
1.4.3 Ruang Lingkup Tempat	25
1.4.4 Ruang Lingkup Waktu	25
1.5 Tujuan Penelitian	25
1.6 Manfaat Penelitian	26

BAB II	28
LANDASAN TEORI	28
2.1 Konsep Dasar Pasar Efisien	28
2.2 Anomali Pasar (Market Anomalies)	32
2.3 Investasi	32
2.4 Saham	33
2.5 Penelitian Terdahulu	35
2.6 Kerangka Pemikiran	39
2.7 Pengembangan Hipotesis	39
2.8 Hipotesis Umum	41
3.1 Jenis penelitian	42
3.2 Sumber Data	42
3.3 Metode Pengumpulan Data	42
3.4 Populasi dan Sampel	43
3.4.1 Populasi	43
3.4.2 Sampel	43
3.5 Teknik Analisis Data	44
3.6 Uji Persyaratan Data	44
3.6.1 Uji Normalitas.....	44
3.7 Teknik Pengujian Hipotesis	45
3.7.1 Uji Paired Sample T	45

BAB IV	47
HASIL DAN PEMBAHASAN	47
4.1 Deskripsi Objek	47
4.1.2 Sentul City Tbk	47
4.1.3 Bumi Serpong Damai Tbk	48
4.1.4 Cowell Development Tbk.....	48
4.1.5 Ciputra Development Tbk	49
4.1.6 Duta Pertiwi Tbk	49
4.1.7 Gading Development Tbk	49
4.1.8 Gowa Makassar Tourism Development Tbk.	50
4.1.9 Jaya Real Property Tbk	50
4.1.10 Kawasan Industri Jababeka Tbk	51
4.1.11 Lippo Cikarang Tbk	51
4.1.12 Lippo Karawaci Tbk.....	51
4.1.13 Pudjiadi Prestige Tbk	52
4.1.14 Pakuwon Jati Tbk	52
4.1.15 Roda Vivatex Tbk	52
4.1.16 Pikko Land Development Tbk	53
4.1.17 Suryamas Dutamakmur Tbk	53
4.1.18 Summarecon Agung Tbk	53
4.1.19 Sitara Propertindo Tbk	54
4.1.20 Forza Land Indonesia Tbk	54

4.1.21 Plaza Indonesia Realty Tbk	54
4.2 Hasil Penelitian	55
4.2.1 Hasil Perhitungan Variabel	55
4.3 Hasil Analisis Statistik	56
4.4 Uji Normalitas	57
4.5.1 Uji Paired Sample T-Test	59
4.6 Pembahasan	60
4.6.1 Rabu Pon dan Rabu biasa terhadap return saham	60
4.6.2 Kamis Wage dan Kamis biasa terhadap return saham	61
4.6.2 Jum'at Kliwon dan Jum'at Biasa terhadap return saham	61
BAB V	63
KESIMPULAN DAN SARAN	63
5.1 Saran	63
5.2.1 Bagi Invesror.....	63
5.2.2 Bagi Peneliti Selanjutnya	64

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Siklus Mingguan Baris (Kalender) dan Pancawara.....	4
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	19
Tabel 3.1 Hasil Kriteria Pengambilan Sampel.....	28
Tabel 4.1 Hasil Rata – Rata Retun Saham	38
Tabel 4.2 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	40
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas.....	41
Tabel 4.4 Hasil Uji Paired Samples Test (Uji T).....	42

DAFTAR GAMBAR

1.1 Grafik Pergerakan Rata – Rata Return Saham Harian.....	5
--	---