

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN JUDUL DALAM.....	ii
HALAMANPERNYATAAN.....	iii
HALAMANPERSETUJUAN.....	iv
HALAMANPENGESEAHAN.....	v
HALAMANPERSEMBAHAN.....	vi
ABSTRACT.....	vii
ABSTRAK.....	viii
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	ix
HALAMAN MOTTO.....	x
KATA PENGANTAR.....	xi
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvii
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 LatarBelakang.....	1
1.2 RumusanMasalah.....	6
1.3 Ruang LingkupPenelitian.....	6
1.3.1 Ruang LingkupSubyek.....	6
1.3.2 Ruang LingkupObyek.....	6
1.3.3 Ruang LingkupTempat.....	6

1.4 Tujuan penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Sistematika Penulisan	8

BAB II LANDASAN TEORI

2.1. Efisiensi Pasar	9
2.2. Anomali Pasar	10
2.3. <i>Monthly Effect</i>	11
2.4. Reaksi Pasar	11
2.5. <i>Return Saham</i>	11
2.5.1 <i>Actual Return</i>	12
2.5.2 <i>Expected Return</i>	12
2.5.3 <i>Abnormal Return</i>	12
2.5.4 <i>Average Abnormal Return</i>	12
2.6 Pengembangan hipotesis	13
2.7 Penelitian Terdahulu	14
2.8 Kerangka Pemikiran.....	17
2.9 Hipotesis Umum	18

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Jenis Penelitian.....	19
3.2 Sumber Data.....	19
3.3 Metode Pengumpulan Data	20
3.4 Populasi dan sampel	20
3.5 Metode Analisis Data	20
3.6 Uji Statistik.....	23
3.7 Pengujian hipotesis.....	25

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskripsiobjek.....	26
4.2 Hasilperhitungan	31
4.3 HasilUjiPrasyarat	36
4.4 Hasilujihipotesis	38
4.5 HasilPenelitian	42
4.6 Pembahasan.....	45

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 . Simpulan.....	47
5.2. Saran	47

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

	Halaman
2.1. Penelitian Terdahulu	14
3.1. Tabel Kriteria Sampling	21
4.1. Hasil Uji Normalitas data (sebelum-selama) Ramadhan	37
4.2. Hasil Uji Normalitas data saham Bulanan	38
4.3. Hasil Uji Paired Sample T-test.....	39
4.4. Hasil Uji Mann Whitney Test	40
4.5. Hasil Uji Independent Sample T-test	41

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
1.1. Indeks Tendensi Konsumen 2019	4
2.1. Bagan Kerangka Pemikiran.....	17
3.1. <i>Event Period</i>	22
4.1. Pergerakan <i>Actual Return</i> Saham Sebelum-Selama Ramadhan	31
4.2. Grafik Pergerakan <i>Actual Return</i> Saham Bulanan.....	32
4.3. Pergerakan <i>Expected Return</i> Saham Sebelum-Selama Ramadhan	33
4.4. Grafik Pergerakan <i>Expected Return</i> Saham Bulanan.....	34
4.5. Pergerakan <i>Abnormal Return</i> Saham Sebelum-Selama Ramadhan	35
4.6. Grafik Pergerakan <i>Abnormal Return</i> Saham Bulanan	36