

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING

LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x

BAB I. PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Identifikasi Masalah	6
1.3 Pembatasan Masalah	7
1.4 Perumusan Masalah	7
1.5 Tujuan Penelitian	8
1.6 Manfaat Penelitian	9

BAB II. KAJIAN PUSTAKA

2.1 Kerangka Teori.....	10
2.1.1 Hari Perdagangan	10
2.1.1.1 Sistem Perdagangan Efek	10
2.1.1.2 Jenis-Jenis Pasar	11
2.1.2 Return Saham	13
2.1.3 Efisiensi Pasar	14
2.1.3.1 Pengertian Efisiensi Pasar	14
2.1.3.2 Tingkatan Efisiensi Pasar	15
2.1.3.3 Bentuk Efisiensi Pasar	17
2.1.4 Anomali Pasar Modal.....	18
2.1.4.1 Pengertian Anomali Pasar Modal.....	18
2.1.4.2 The Day of The Week Effect dan Monday Effect.....	18

2.1.4.3 Week Four Effect	19
2.1.4.4 Bad Friday	20
2.1.5 Jakarta Islamic Index (JII).....	20
2.1.5.1 Kriteria Pemilihan Saham yang Memenuhi Prinsip-Prinsip Syariah.....	21
2.1.5.2 Kriteria Pemilihan Saham Jakarta Islamic Index	22
2.1.5.3 Evaluasi Indeks dan Pergantian Saham.....	23
2.1.5.4 Hari Dasar Jakarta Islamic Index	23
2.2 Penelitian Relevan.....	23
2.3 Kerangka Berpikir.....	25
2.4 Hipotesis.....	28

BAB III. METODE PENELITIAN

3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian	29
3.1.1 Lokasi Penelitian.....	29
3.1.2 Waktu Penelitian	29
3.2 Populasi dan Sampel	29
3.2.1 Populasi.....	29
3.2.2 Sampel.....	29
3.3 Variabel Penelitian dan Defenisi Operasional	30
3.3.1 Variabel Penelitian	30
3.3.2 Defenisi Operasional.....	31
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	31
3.5 Teknik Analisis Data.....	32
3.5.1 Uji Normalitas Data	32
3.5.2 Uji Hipotesis.....	32
3.5.2.1 Uji Hipotesis Pertama.....	33
3.5.2.2 Uji Hipotesis Kedua	33
3.5.2.3 Uji Hipotesis Ketiga	33

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN



4.1 Hasil Penelitian	35
4.1.1 Gambaran Umum Sampel	35
4.1.2 Deskriptif Data Penelitian	36
4.2 Analisis Data Penelitian	39
4.2.1 Uji Normalitas	39
4.2.2 Uji Hipotesis.....	41
4.2.2.1 Pengujian Hipotesis Pertama.....	42
4.2.2.2 Pengujian Hipotesis Kedua.....	44
4.2.2.3 Pengujian Hipotesis Ketiga	44
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Simpulan	48
5.2 Saran.....	49
DAFTAR PUSTAKA.....	xi
LAMPIRAN	