

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>PENGESAHAN.....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>LEMBAR PERSEMBAHAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>v</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xii</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>xiii</b>

### **BAB I PENDAHULUAN**

A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah.....	5
C. Tujuan Penelitian .....	6
D. Manfaat Penelitian.....	6

### **BAB II TINJAUAN PUSTAKA**

A. Landasan Teori .....	7
-------------------------	---

1. Investasi.....	7
2. Pasar Modal .....	8
3. Pasar Modal Efisien.....	10
4. Teori Informasi .....	12
5. Anomali Pasar.....	14
6. <i>January Effect</i> .....	18
7. Saham .....	19
8. <i>Return Saham</i> .....	20
9. <i>Abnormal Return</i> .....	21
B. Penelitian Terdahulu.....	21
C. Kerangka Konseptual .....	25
D. Hipotesis Penelitian .....	25

### **BAB III METODE PENELITIAN**

A. Jenis Penelitian .....	26
B. Jenis dan Sumber Data .....	26
C. Populasi dan Sampel.....	26
D. Prosedur Pengambilan Data.....	27
E. Definisi Operasional Variabel .....	27
F. Teknik Analisis Data .....	30

### **BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

A. Hasil Penelitian.....	33
--------------------------	----

1. Analisis Deskriptif.....	33
2. Hasil Analisis.....	35
B. Pembahasan .....	38
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
A. Kesimpulan.....	43
B. Saran.....	43
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>45</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>47</b>