

DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK.....	i
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
BAB I : PENDAHULUAN	
A.Latar Belakang	1
B. Identifikasi dan Perumusan Masalah	3
C. Tujuan Penelitian.....	4
D. Manfaat Penelitian	4
BAB II: TINJAUAN PUSTAKA	
A. Tinjauan Teori.....	5
1. Definisi Pasar Modal.....	5
2. Konsep Efisiensi Pasar Modal	5
3. Bentuk Efisiensi Pasar Modal.....	7
4. Anomali Pasar.....	9
B.Penelitian Terdahulu	14
C.Kerangka Pemikiran.....	16
D.Perumusan Hipotesis.....	17

BAB III: METODE PENELITIAN

A. Populasi.....	20
B. Sampel dan Teknik Sampling	20
C. Jenis dan Sumber Data	21
D. Teknik Pengumpulan Data	22
E. Teknik Analisis Data	22

BAB IV: HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Analisis Deskriptif	26
1. Pasar Modal Indonesia	26
2. Pasar Modal China.....	28
3. Pasar Modal India	30
B. Pengujian Hipotesis dan Pembahasan	32
1. Pengujian Hipotesis	32
a.) Pengujian Terhadap Anomali <i>Day Of The Week Effect</i>	32
1.) Pengujian terhadap anomali <i>Week Day Effect</i> di pasar modal Indonesia	33
2.) Pengujian terhadap anomali <i>Week Day Effect</i> di pasar modal China	45
3.) Pengujian terhadap anomali <i>Week Day Effect</i> di pasar modal India.....	35
b.) Pengujian Terhadap Anomali <i>Week End Effect</i>	35
1.) Pengujian terhadap anomali <i>Week End Effect</i> di pasar modal Indonesia.....	37
2.) Pengujian terhadap anomali <i>Week End Effect</i> di pasar modal China.....	38
3.) Pengujian terhadap anomali <i>Week End Effect</i> di pasar modal India	39
2. Pembahasan.....	40

BAB V: SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	43
B. Saran.....	44

DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN	48