

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	iii
DAFTAR TABEL	v
DAFTAR GAMBAR	vi
DAFTAR LAMPIRAN	vii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah	5
C. Tujuan Penelitian.....	5
D. <i>Manfaat Penelitian</i>	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	6
A. Landasan Teori	6
1. Investasi	6
2. Pasar Modal.....	7
3. Pasar Modal Efisien	9
4. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	10
5. Teori Informasi	13
6. Anomali Pasar	14
7. January Effect	18
8. Saham.....	20
9. Return Saham.....	21
B. Penelitian Terdahulu	22
C. Kerangka Konseptual.....	25
D. Hipotesis Penelitian	25
BAB III METODE PENELITIAN	26
A. Jenis Penelitian	26
B. Objek Penelitian.....	26
C. Periode Pengamatan.....	26
D. Jenis dan Sumber Data.....	26
E. Prosedur Pengambilan Data.....	27
F. Definisi Operasional Variabel	27