

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN MOTTO.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Pokok Masalah.....	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	7
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
1.5. Hipotesis.....	8
1.6. Metodologi Penelitian.....	9
1.6.1. Obyek Penelitian.....	9
1.6.2. Metode Pengambilan Data.....	9
1.6.3. Metode Analisis Data.....	9
1.7. Sistematika Penulisan.....	10

BAB II LANDASAN TEORI.....	11
2.1. Konsep Efisiensi Pasar.....	11
2.2. Bentuk Efisiensi Pasar.....	14
2.3. Implikasi Hipotesis Pasar yang Efisien.....	16
2.4. Anomali Pasar.....	19
2.5. Weekend Effect.....	22
2.6. Faktor-faktor Penyebab Munculnya Weekend effect.....	27
 BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	 31
3.1. Obyek Penelitian.....	31
3.2. Metode Pengambilan Data.....	33
3.3. Metode Analisis Data.....	33
 BAB IV ANALISIS DATA.....	 35
4.1. Analisis Deskripsi Data.....	35
4.2. Analisis Data.....	36
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	 73
5.1. Kesimpulan.....	73
5.2. Saran.....	74
 Daftar Pustaka.....	 76
Lampiran.....	77

DAFTAR TABEL

3.1. Nama-nama Perusahaan Sampel.....	31
4.1. Jumlah Hari Observasi Menurut Periode Penelitian Tahun 2001-2002.....	36
4.2. Deskripsi Return Harian Saham Tahun 2001.....	37
4.3. Hasil Pengujian Anova One Way Tahun 2001.....	39
4.4. Hasil uji dengan Post Hoc Tests Tahun 2001.....	41
4.5. Deskripsi Return Harian Saham Tahun 2002.....	55
4.6. Hasil Pengujian Anova One Way Tahun 2002.....	57
4.7. Hasil uji dengan Post Hoc Tests Tahun 2002.....	59



DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 : Daftar Rekapitulasi return Saham 2001-2002
- Lampiran 2 : Uji Oneway 2001-2002 serta table F
- Lampiran 3 : Post Hoc Tests 2001-2002
- Lampiran 4 : Uji t 2001 dan table t
- Lampiran 5 : Uji t 2002 dan table t

