

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Surat Pernyataan Keaslian Tesis.....	ii
Halaman Pengesahan Usulan Penelitian	iii
Abstract	iv
Abstrak	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xi
Daftar Rumus	xii
 1. PENDAHULUAN	 1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah	8
1.3. Tujuan dan Kegunaan	9
1.3.1. Tujuan	9
1.3.2. Kegunaan	9
 2. TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL	 10
2.1. Pengertian Pasar Modal	10
2.2. Konsep Efisiensi Pasar Modal	11
2.3. Bentuk Efisiensi Pasar Modal	12
2.3.1. Efisiensi pasar bentuk lemah.	14
2.3.2. Efisiensi bentuk setengah kuat	14
2.3.3. Efisiensi bentuk kuat	15
2.4. Anomali Pasar	15
2.4.1. January Effect	16
2.4.2. Size Effect	19
2.5. Penelitian Terdahulu	21
2.6. Kerangka Pemikiran Teoritis	27

2.7. Hipotesis	28
2.8. Definisi Operasional Variabel	28
3. METODE PENELITIAN	29
3.1. Jenis dan Sumber Data	29
3.2. Populasi dan Pemilihan Sampel	29
3.3. Metode Pengumpulan Data	30
3.4. Teknik Analisis dan pengujian Hipotesis	30
4. ANALISIS DATA	33
4.1. Uji Asumsi Regresi Linear	33
4.1.1. Uji Normalitas	33
4.1.2. Uji Heterokedastisiti	35
4.1.3. Uji Multikolinearitas	36
4.2. Analisis Hipotesis Pertama	37
4.3. Pengujian Hipotesis Ke Dua	40
5. KESIMPULAN DAN IMPLIKASI KEBIJAKAN.....	43
5.1. Kesimpulan	43
5.2. Implikasi Teoritis	44
5.3. Implikasi Kebijakan Manajerial	45
5.4. Keterbatasan Penelitian	45
5.5. Agenda Penelitian Mendatang	46
REFERENSI	47
LAMPIRAN	49

FEB UNDIP