

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	11
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	14
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	14
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	14
1.4 Sistematika Penulisan.....	15
BAB II TELAAH PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu.....	18

2.1.1	Perilaku Harga Saham.....	18
2.1.2	Pendekatan Analisis Saham.....	19
2.1.2.1	<i>Fundamental Approach</i>	19
2.1.2.2	<i>Technical Approach</i>	20
2.1.3	Pentingnya Informasi.....	22
2.1.4	<i>Return</i> Saham.....	24
2.1.5	Dampak Sebelum Hari Libur (<i>Pre Holiday Effect</i>).....	26
2.1.6	Dampak Sesudah Hari Libur (<i>Post Holiday Effect</i>).....	27
2.1.7	Dampak Hari Perdagangan Sebelum dan Sesudah Libur terhadap <i>Return</i> Saham.....	28
2.2	Penelitian Terdahulu.....	35
2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis.....	38
2.3.1	<i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah Hari Libur Keagamaan.....	40
2.3.2	<i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah Hari Libur Nasional.....	41
2.3.3	<i>Return</i> Saham Sebelum Hari Libur Keagamaan dan Sebelum Hari Libur Nasional.....	41
2.3.4	<i>Return</i> Saham Sesudah Hari Libur Keagamaan dan Sesudah Hari Libur Nasional.....	42
2.4	Hipotesis.....	43

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	45
3.2	Populasi dan Penentuan Sampel.....	46
3.3	Jenis dan Sumber Data.....	47
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	47
3.5	Metode Analisis.....	48
3.5.1	Analisis Statistik Deskriptif.....	49
3.5.2	Uji Normalitas.....	49
3.5.3	Uji Hipotesis.....	49
3.5.3.1	<i>Paired Sample T-Test</i>	50
3.5.3.2	<i>Independent Sample T-Test</i>	52

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	53
4.1.1	Bursa Efek Indonesia.....	53
4.2.1	Gambaran Umum IHSG.....	54
4.2	Analisis Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	55
4.2.1	Statistik Deskriptif Sebelum dan Sesudah Hari Libur Keagamaan.....	55
4.2.2	Statistik Deskriptif Sebelum dan Sesudah Hari Libur Nasional.....	58
4.3	Pengujian dan Analisis Data.....	60
4.3.1	Uji Normalitas Data.....	60
4.3.2	Uji Hipotesis.....	62

4.3.2.1 Pengujian Hipotesis 1.....	62
4.3.2.2 Pengujian Hipotesis 2.....	65
4.3.2.3 Pengujian Hipotesis 3.....	67
4.3.2.4 Pengujian Hipotesis 4.....	69
BAB V PENUTUP	
5.1 Kesimpulan.....	73
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	74
5.3 Saran.....	75
DAFTAR PUSTAKA.....	77
DAFTAR LAMPIRAN.....	80