

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul.....	i
SERTIFIKASI.....	ii
Halaman Pengesahan Tesis	iii
<i>Abstract</i>	iv
Abstrak	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Tabel	xii
Daftar Gambar.....	xiii
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah	11
1.3. Tujuan Penelitian	12
1.4. Kegunaan Penelitian.....	13
 BAB II TELAAH PUSTAKA	
2.1. Anomali Pasar (<i>Market Anomalies</i>).....	14
2.2. <i>January Effect</i>	16
2.3. Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	18
2.4. Pengujian Efisiensi Pasar	20
2.5. Momentum	22
2.6. <i>Prospect Theory</i>	23

2.7. <i>Behavioral Finance</i>	26
2.8. <i>Return</i> (Tingkat Pengembalian)	27
2.9. Penelitian Terdahulu	29
2.10. Pengaruh antar Variabel	33
2.11. Kerangka Pemikiran Teoritis	37

BAB III METODE PENELITIAN

3.1. Jenis dan Sumber Data	39
3.2. Populasi dan Sampel	39
3.3. Metode Pengumpulan data	41
3.4. Definisi Operasional Variabel	42
3.4.1. Variabel Dependen	42
3.4.2. Variabel Independen	43
3.5. Teknik Analisis Data	48
3.5.1. Pengumpulan Data dari Sampel	49
3.5.2. Analisis Statistik Deskriptif	49
3.5.3. Uji Asumsi Klasik	50
3.5.3.1. Uji Normalitas	50
3.5.3.2. Uji Multikolinearitas	51
3.5.3.3. Uji Heteroskedastisitas	52
3.5.3.4. Uji Autokorelasi	53

3.5.4. Pengukuran <i>Goodness of Fit</i> suatu Model	54
3.5.4.1. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	54
3.5.4.2. Uji Koefisien Determinan (R^2)	55
3.5.4.3. Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	55

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1. Gambaran umum Obyek Penelitian	56
4.2. Statistik Deskriptif Variabel	57
4.3. Hasil Analisis Data dan Pembahasan	59
4.3.1. Hasil Uji Asumsi Klasik	59
4.3.1.1. Hasil Uji Normalitas	59
4.3.1.2. Hasil Uji Multikolinearitas	60
4.3.1.3. Hasil Uji Heteroskedastisitas	61
4.3.1.4. Hasil Uji Autokorelasi	62
4.3.2. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	64
4.3.3. Uji Koefisien Determinan (R^2)	65
4.3.4. Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	65
4.3.4.1. Uji Hipotesis (H_1) pengaruh antara <i>Short Return</i> terhadap <i>Return</i> Saham Bulan Januari	67
4.3.4.2. Uji Hipotesis (H_2) pengaruh antara <i>Intermediate Return</i> terhadap <i>Return</i> Saham Bulan Januari	68
4.3.4.3. Uji Hipotesis (H_3) pengaruh antara <i>Long Return</i> terhadap <i>Return</i> Saham Bulan Januari	68

4.3.4.4. Uji Hipotesis (H_4) pengaruh antara <i>Turnover</i> terhadap <i>Return Saham Bulan Januari</i>	69
4.3.4.5. Uji Hipotesis (H_5) pengaruh antara <i>Market Capitalization</i> terhadap <i>Return Saham Bulan Januari</i>	70
4.2.2.6. Uji Hipotesis (H_6) pengaruh antara <i>Capital Gain Overhang</i> terhadap <i>Return Saham Bulan Januari</i>	71

BAB V KESIMPULAN DAN IMPLIKASI HASIL PENELITIAN

5.1. Kesimpulan	72
5.2. Implikasi Hasil Penelitian	73
5.2.1. Implikasi Teoritis	73
5.2.2. Implikasi Kebijakan	75
5.3. Keterbatasan Penelitian	76
5.4. Agenda Mendatang	77
DAFTAR PUSTAKA	78
LAMPIRAN	80
RIWAYAT HIDUP.....	114