

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI .....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
ABSTRAK .....	vii
<i>ABSTRACT</i> .....	viii
DAFTAR ISI .....	ix
DAFTAR TABEL .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	5
1.3 Tujuan Penelitian .....	6
1.4 Manfaat Penelitian .....	6
1.5 Sistematika Penelitian .....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	9
2.1 Landasan Teori .....	9
2.1.1 Pengertian dan Jenis Pasar Modal .....	9
2.1.2 Efisiensi Pasar Modal .....	10
2.1.3 Anomali Pasar Efisien .....	12
2.1.4 Pengaruh Bulan Perdagangan .....	14

2.1.5 Pengaruh Bulan Barometer .....	15
2.1.6 Pendapatan Pasar .....	16
2.2 Penelitian Terdahulu .....	18
2.3 Perumusan Hipotesis .....	21
2.4 Model Analisis .....	21
2.4.1 Pengaruh Bulan Perdagangan .....	21
2.4.2 Pengaruh Bulan Barometer .....	22
2.5 Kerangka Pemikiran .....	23
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b>	<b>24</b>
3.1 Pendekatan Penelitian .....	24
3.2 Identifikasi Variabel .....	24
3.3 Definisi Operasional Variabel .....	24
3.4 Jenis dan Sumber Data .....	25
3.5 Prosedur Penentuan Sampel .....	25
3.6 Prosedur Pengumpulan Data .....	26
3.7 Teknik Analisis .....	27
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>31</b>
4.1 Deskripsi Data .....	31
4.2 Uji Asumsi .....	32
4.3 Analisis Model dan Pengujian Hipotesis .....	34
4.3.1 Bulan Perdagangan .....	34
4.3.2 Bulan Barometer .....	36
4.4 Pembahasan .....	37

4.4.1 Pengaruh bulan perdagangan terhadap pendapatan pasar di Bursa Efek Indonesia.....	37
4.4.2 Pengaruh bulan barometer terhadap pendapatan pasar di Bursa Efek Indonesia .....	39
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>40</b>
5.1 Kesimpulan .....	40
5.2 Saran .....	40



## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Ringkasan Anomali Pasar .....	13
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif Pendapatan Pasar .....	32
Tabel 4.2	Hasil Analisis Regresi Bulan Perdagangan .....	35
Tabel 4.4	Hasil Analisis Regresi Bulan Barometer .....	36



## DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Pendapatan Pasar
- Lampiran 2 Hasil Statistik Deskriptif Pendapatan Pasar
- Lampiran 3 Hasil Uji Normalitas Bulan Perdagangan dan Bulan Barometer
- Lampiran 4 Hasil Uji Autokorelasi Bulan Perdagangan dan Bulan Barometer
- Lampiran 5 Hasil Uji Stasioneritas Bulan Perdagangan dan Bulan Barometer
- Lampiran 6 Hasil Analisis Regresi Bulan Perdagangan dan Bulan Barometer

