

## DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI .....	ii
HALAMAN PERSEMBAHAN DAN MOTTO .....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiii
ABSTRAKSI .....	xiv
BAB I (PENDAHULUAN) .....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	8
1.4 Manfaat Penelitian .....	8
BAB II (KAJIAN PUSTAKA) .....	10
2.1 Landasan Teori.....	10
2.1.1 Pasar Modal.....	10
2.1.2 Efisiensi Pasar Modal.....	11

2.1.3	Harga Saham .....	13
2.1.4	Return .....	15
2.1.5	Abnormal Return .....	16
2.1.6	Anomali Pasar .....	18
2.1.7	Anomali Ramadhan .....	19
2.1.8	Indeks Harga Saham Sektoral .....	21
2.2	Penelitian Terdahulu .....	23
2.3	Pengembangan Hipotesis .....	24
2.4	Kerangka Pemikiran.....	26
<b>BAB III (METODE PENELITIAN).....</b>		<b>27</b>
3.1	Jenis Penelitian.....	27
3.2	Populasi dan Sampel .....	28
3.2.1	Populasi.....	28
3.2.2	Sampel.....	29
3.3	Definisi Operasional Variabel.....	30
3.4	Jenis dan Sumber Data.....	32
3.5	Metode Pengumpulan Data.....	33
3.6	Metode Analisis Data.....	33
3.6.1	Statistik Dekriptif .....	33
3.6.2	Uji Normalitas Data.....	33
3.6.3	Uji Hipotesis (T test).....	34

BAB IV (HASIL DAN PEMBAHASAN) .....	34
4.1 Sektor Infrastruktur .....	34
4.2 Jenis Penelitian.....	36
4.3 Deskripsi Data.....	36
4.3.1 Statistik Deskriptif .....	38
4.3.2 Uji Normalitas Data Return Saham dan Abnormal Return....	41
4.3.3 Uji T Test .....	43
4.3.3.1 Uji T Test Return Saham .....	43
4.3.3.2 Uji T Test Abnormal Return .....	44
4.4 Pembahasan.....	45
BAB V (PENUTUP).....	48
5.1 Simpulan .....	48
5.2 Saran .....	49
5.3 Keterbatasan Penelitian dan Agenda Penelitian Mendatang .....	49
5.3.1 Keterbatasan Penelitian.....	49
5.3.2 Agenda Penelitian Mendatang .....	50
DAFTAR PUSTAKA .....	51

**DAFTAR GRAFIK & GAMBAR**

Gambar	Halaman
1.1 Perkembangan Kinerja Indeks Sektoral 2004-2015 .....	6
2.1 Kerangka Pemikiran.....	27

## DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
2.1 Penelitian Terdahulu .....	24
4.1 Daftar sampel perusahaan yang digunakan dalam penelitian .....	37
4.2 Segmentasi data .....	38
4.3 Statistik Deskriptif Tahun 2015-2017.....	40
4.4 Uji Normalitas data Return Saham 2015-2017.....	43
4.5 Uji Normalitas data Abnormal Return 2015-2017.....	43
4.6 Uji Normalitas data return Saham 2015-2017 setelah dirubah menggunakan LN.....	44
4.7 Uji T Test Return Saham sebelum ramadhan dan selama ramadhan tahun 2015-2017 .....	44
4.8 Uji T Test Return Saham selama ramadhan dan setelah ramadhan tahun 2015-2017 .....	45
4.9 Uji T Test Abnormal Return sebelum ramadhan dan selama ramadhan tahun 2015-2017 .....	46
4.10 Uji T Test Abnormal Return selama ramadhan dan setelah ramadhan tahun 2015-2017 .....	46

**DAFTAR LAMPIRAN**

Lampiran	Keterangan
I	Daftar Perusahaan Sektor Infrastruktur
II	<i>Output</i> Deskriptif Statistik
III	<i>Output</i> Uji Normalitas Data
IV	<i>Output Uji Beda (T Test)</i>