

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACK	ii
KATA PENGANTAR	iii
UCAPAN TERIMA KASIH	iv
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Identifikasi Masalah	6
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian.....	6
1.3.1 Maksud Penelitian.....	6
1.3.2 Tujuan Penelitian	6
1.4 Kegunaan Hasil Penelitian	7
1.5 Metode Penelitian	8
1.6 Waktu dan Tempat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Manajamen Keuangan	10
2.1.1 Pengertian Manajemen Keuangan	10
2.1.2 Fungsi Manajemen Keuangan	10
2.1.3 Tujuan Manajemen Keuangan	11
2.2 Investasi	12
2.2.1 Pengertian Investasi	12
2.2.2 Tujuan Investasi	13
2.2.3 Tipe-tipe Investasi	13

2.2.4	Faktor Terjadinya Investasi	13
2.2.5	Risiko Investasi	14
2.3	Pasar Modal	15
2.3.1	Pengertian Pasar Modal	15
2.3.2	Peran dan Manfaat Pasar Modal	15
2.3.3	Jenis Pasar Modal	16
2.3.4	Instrumen-instrumen Pasar Modal	17
2.4	Saham	18
2.4.1	Pengertian Saham.....	18
2.4.2	Jenis-Jenis Saham	19
2.4.3	Harga Saham	20
2.4.4	Faktor-faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham ...	20
2.5	Return	21
2.5.1	Return Saham	22
2.6	Abnormal Return	24
2.7	Indeks Harga Saham	26
2.8	Pasar Efisien.....	28
2.9	Volume Perdagangan.....	30
2.10	Anomali Pasar	31
2.10.1	Pengertian Anomali Pasar	31
2.10.2	Jenis-jenis Anomali	31
2.11	Penelitian Terdahulu	33
2.11.1	Abnormal Return Saham Pada January Effect	33
2.11.2	Volume Perdagangan Saham Pada January Effect..	34
2.11	Hipotesis	38

BAB III METODE PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian	39
3.1.1	Sejarah LQ45	39
3.1.2	Deskripsi Perusahaan	40

3.2	Metode Penelitian	54
3.2.1	Jenis dan Sumber Data	55
3.2.2	Teknik Pengumpulan Data.....	55
3.2.3	Operasional Variabel dan Pengukuran Variabel	55
3.2.4	Populasi dan Sample Penelitian	59
3.3	Teknik Analisis Data	62

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Gambaran Abnormal Return Saham-saham LQ45 Selama Periode 2010-2015.....	66
4.1.1	Kondisi Abnormal Return Saham-saham LQ45 Selama Periode 2010-2015	66
4.2	Gambaran Volume Perdagangan Saham-saham LQ45 Selama Periode 2010-2015	73
4.2.1	Kondisi Volume Perdagangan Saham-saham LQ45 Selama Periode 2010-2015	73
4.3	Analisis Perbedaan Abnormal Return Saham di bulan Desember dengan Abnormal Return Saham di bulan Januari pada Perusahaan yang Saham-sahamnya Masuk Katergori LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2015.....	80
4.3.1	Uji Normalitas	80
4.3.2	Uji Hipotesis	81
4.4	Analisis Perbedaan Volume Perdagangan Saham di bulan Desember dengan Volume Perdagangan Saham di bulan Januari pada Perusahaan yang Saham-sahamnya Masuk Katergori LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2015.....	93
4.4.1	Uji Normalitas	94
4.4.2	Uji Hipotesis	95

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 107
5.2 Saran 108

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

