

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN	ii
MOTTO	iii
ABSTRAK	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
KATA PENGHANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xvi
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2 Identifikasi Dan Rumusan Masalah.....	11
1.2.1 Identifikasi Masalah	11
1.2.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Maksud Dan Tujuan Penelitian.....	12
1.3.1 Maksud Penelitian	12

1.3.2	Tujuan Penelitian.....	13
1.4	Kegunaan Penelitian.....	13
1.4.1	Kegunaan Praktis	13
1.4.2	Kegunaan Akademis.....	14
1.5	Lokasi Dan Waktu Penelitian.....	14
1.5.1	Lokasi Penelitian.....	14
1.5.2	Waktu Penelitian.....	15

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN

	DAN HIPOTESIS.....	16
2.1	Kajian Pustaka	16
2.1.2	<i>January Effect</i>	17
2.1.2.1	Pengertian <i>January Effect</i>	17
2.1.2.2	Pengukuran <i>January Effect</i>	18
2.1.3	<i>Size Effect</i>	18
2.1.3.1	Pengertian <i>Size Effect</i>	18
2.1.3.2	Pengukuran <i>Size Effect</i>	19
2.1.4	<i>Return Saham</i>	20
2.1.4.1	Pengertian <i>Return Saham</i>	20
2.1.4.2	Komponen-komponen <i>Return saham</i>	22
2.1.4.3	Pengukuran <i>Return Saham</i>	22

2.1.5	Hasil Penelitian Terdahulu	24
2.2	Kerangka Pemikiran	34
2.2.1	Pengaruh <i>Januari Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	35
2.2.2	Pengaruh <i>Size Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	37
2.2.3	Pengaruh <i>January Effect</i> dan <i>Size Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	37
2.2.4	Paradigma Penelitian	38
2.3	Hipotesis.....	39
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		40
3.1	Objek Penelitian.....	40
3.2	Metode Penelitian	40
3.2.1	Desain Penelitian.....	42
3.2.2	Operasionalisasi Variabel	44
3.2.3	Sumber dan Teknik Penentuan Data.....	47
3.2.3.1	Sumber Data.....	47
3.2.3.2	Teknik Penentuan Data.....	47
3.2.4	Teknik Pengumpulan Data	51
3.2.5	Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis	52
3.2.5.1	Rancangan Analisis.....	52
3.2.5.1.1	Rancangan Analisis Deskriptif	53

3.2.5.1.2	Rancangan Analisis Verifikatif.....	54
3.2.5.2	Pengujian Hipotesis	68
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		74
4.1	Gambaran Umum Perusahaan	74
4.1.1	Sejarah Perusahaan	77
4.1.1.1	PT. Adaro Energy Tbk.....	77
4.1.1.2	PT. Astra International Tbk	79
4.1.1.3	PT. Indofood CBP Sukses Makmur Tbk.....	80
4.1.1.4	PT. Indofood Sukses Makmur Tbk.....	81
4.1.1.5	PT. Kalbe Farma Tbk	83
4.1.1.6	PT. Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk	85
4.1.1.7	PT. Semen Indonesia (Persero) Tbk	88
4.2	Analisis Deskriptif	93
4.2.1	Perkembangan <i>January Effect</i> pada Perusahaan Yang Tergabung Dalam Saham Jakarta Islamic Index (JII) di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2018.....	93
4.2.2	Perkembangan <i>Size Effect</i> Terhadap Perusahaan Yang Tergabung Dalam Saham Jakarta Islamic Index Di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2018.....	106
4.2.3	Perkembangan <i>Return Saham</i> Terhadap Perusahaan Yang Tergabung Dalam Saham Jakarta Islamic Index Di Bursa Efek	

Indonesia Periode 2014-2018	119
4.3 Analisis Verifikatif	133
4.3.1 Analisis Regresi Linear Berganda	133
4.3.2 Uji Asumsi Klasik	135
4.3.3 Analisis Korelasi	144
4.3.4 Koefisien Determinasi.....	147
4.3.5 Pengujian Hipotesis	148
BAB V PENUTUP	157
5.1 Kesimpulan	157
5.2 Saran.....	158
DAFTAR PUSTAKA	177