

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
ABSTRAK .....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
MOTTO .....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Perumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian .....	8
D. Manfaat Penelitian .....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
A. Kajian Teoritis dan Empiris .....	11
1. Pasar Modal.....	11
2. Efisiensi Pasar Modal.....	16
3. Indeks Bursa Saham .....	19
4. Indeks LQ-45 .....	21
5. Anomali Pasar .....	22
6. <i>Holiday Effect</i> .....	25
7. Return.....	27
B. Penelitian Terdahulu .....	28
C. Kerangka Konseptual .....	32

D. Hipotesis Penelitian.....	33
BAB III METODE PENELITIAN.....	35
A. Ruang Lingkup Penelitian.....	35
B. Periode Penelitian Event .....	35
C. Jenis dan Sumber Data .....	35
D. Metode Pengumpulan Data.....	36
E. Variabel Penelitian dan Pengukurannya .....	36
1. Variabel Bebas .....	36
2. Variabel Terikat .....	37
F. Teknik Analisis .....	37
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	37
2. Regresi dengan Variabel <i>Dummy</i> .....	38
a. Uji Normalitas.....	39
b. Uji Multikolinearitas .....	39
c. Uji Heteroskedastisitas.....	40
d. Uji Autokorelasi.....	41
G. Pengujian Hipotesis.....	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
A. Hasil Penelitian .....	45
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	45
2. Pengujian Asumsi Dasar .....	49
a. Uji Normalitas.....	49
b. Uji Multikolinearitas .....	50
c. Uji Autokorelasi .....	51
d. Uji Heteroskedastisitas.....	53
3. Analisis Regresi dengan Variabel <i>Dummy</i> .....	54
B. Pembahasan.....	56
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	59
A. Kesimpulan .....	59
B. Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA .....	61
LAMPIRAN .....	64

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Perbedaan dan Persamaan.....	28
Tabel 2.2 Penelitian Terdahulu Sebagai Pendukung.....	30
Tabel 3.1 Uji Durbin Watson.....	41
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	45
Tabel 4.2 Hasil Perhitungan Uji Normalitas.....	49
Tabel 4.3 Hasil Perhitungan Uji Multikolinearitas.....	50
Tabel 4.4 Durbin Watson.....	51
Tabel 4.5 Hasil Perhitungan Uji Autokorelasi.....	52
Tabel 4.6 Perbandingan <i>d value</i> Signifikan 5%.....	52
Tabel 4.7 Hasil Perhitungan Uji Heteroskedastisitas.....	53
Tabel 4.8 Hasil Perhitungan Analisis Regresi Variabel <i>Dummy</i> .....	54

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual .....	32
--------------------------------------	----

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data <i>Return</i> Indeks LQ-45 .....	64
Lampiran 2 Statistik Deskriptif .....	70
Lampiran 3 Uji Asumsi Klasik .....	71
Lampiran 4 Uji Regresi Variabel <i>Dummy</i> .....	73