

## DAFTAR ISI

	Halaman
<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	i
<b>HALAMAN PENGESAHAN TESIS</b> .....	ii
<b>HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN TESIS</b> .....	iii
<b>ABSTRACT</b> .....	iv
<b>ABSTRAKSI</b> .....	v
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	vi
<b>DAFTAR ISI</b> .....	ix
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xii
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	xiii
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	xiv
 <b>BAB I : PENDAHULUAN</b>	
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Identifikasi dan Perumusan Masalah.....	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	6
1.4. Manfaat Penelitian.....	6

## **BAB II : TINJAUAN PUSTAKA**

2.1. Tinjauan Teori.....	8
2.1.1. <i>Return Saham</i> .....	8
2.1.2. Analisis Teknikal.....	12
2.1.3. Hipotesis Pasar Efisien (EMH).....	18
2.1.4. Anomali Pasar.....	37
2.1.5. <i>The Day of The Week Effect</i> .....	40
2.1.6. Indeks LQ45.....	40
2.2. Penelitian Terdahulu.....	42
2.3. Kerangka Pemikiran.....	45
2.4. Hipotesis Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	46
2.4.1. Hipotesis Penelitian.....	46
2.4.2. Definisi Operasional Variabel.....	47

## **BAB III : METODE PENELITIAN**

3.1. Jenis Penelitian.....	48
3.2. Populasi.....	48
3.3. Sampel dan Teknik Sampling.....	48
3.4. Jenis dan Sumber Data.....	49
3.5. Teknik Pengumpulan Data.....	50
3.6. Variabel Penelitian.....	50

3.7. Teknik Analisis Data.....	51
3.7.1. Uji Stationeritas.....	51
3.7.2. Uji OLS ( <i>Ordinary Least Square</i> ).....	52
3.7.3. Teknik Analisis.....	54
3.7.4. Uji Hipotesis.....	55

#### **BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

4.1. Deskripsi Hasil Penelitian.....	58
4.2. Statistik Deskriptif <i>Return</i> Saham.....	59
4.3. Pengujian Hipotesis.....	65
4.3.1. Uji Stasioner Data.....	65
4.3.2. Pengujian Terhadap Anomali <i>Return</i> Saham Pada Hari-hari Perdagangan di BEI.....	66
4.4. Pembahasan.....	70

#### **BAB V : SIMPULAN DAN SARAN**

5.1. Kesimpulan.....	73
5.2. Implikasi Teoritis.....	73
5.3. Implikasi Kebijakan Manajemen.....	74
5.4. Saran.....	74

#### **DAFTAR PUSTAKA**

#### **LAMPIRAN**