

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
LEMBAR PENGESAHAN .....	ii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iii
ABSTRAK .....	iv
HALAMAN MOTTO .....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI .....	ix
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian .....	7
D. Manfaat Penelitian .....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	9
A. Landasan Teori .....	9
1. Pengertian Investasi .....	9
2. Tipe Investasi Keuangan .....	9
3. Pengertian Saham .....	10
4. Jenis-Jenis Saham .....	10
a. Saham Biasa .....	10
b. Saham Preferen .....	10
5. Pengertian <i>Return</i> Saham .....	11
6. Jenis-Jenis <i>Return</i> Saham .....	11
a. <i>Return</i> Realisasian ( <i>Realized Return</i> ) .....	11
b. <i>Return</i> Ekspektasian ( <i>Expected Return</i> ) .....	12
7. Pengertian Pasar Modal .....	12
8. Konsep Pasar Modal Efisien .....	12
9. Bentuk-Bentuk Efisiensi Pasar .....	13
a. Efisiensi Pasar Bentuk Lemah .....	13
b. Efisiensi Pasar Bentuk Setengah Kuat .....	13
c. Efisiensi Pasar Bentuk Kuat.....	14
10. Hipotesis Pasar Efisien .....	15
11. Pengertian Anomali Pasar .....	15
12. Bentuk-Bentuk Anomali Pasar .....	15
a. Anomali Perusahaan ( <i>firm anomalies</i> ) .....	15
b. Anomali Musiman ( <i>seasonal anomalies</i> ).....	16

c. Anomali Peristiwa ( <i>event anomalies</i> ) .....	16
d. Anomali Akuntansi ( <i>accounting anomalies</i> ) .....	17
13. Teori <i>Behavioral Finance</i> .....	17
14. Pengertian <i>Day of The Week Effect</i> .....	18
15. Pengertian <i>Monday Effect</i> .....	18
16. Pengertian <i>Weekend Effect</i> .....	19
17. Pengertian Indeks LQ-45 .....	19
18. Kriteria Pemilihan Saham Indeks LQ-45 .....	20
19. Perhitungan Indeks Harga Saham .....	20
B. Penelitian Terdahulu .....	21
C. Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap <i>Return</i> Indeks LQ-45 .....	25
D. Kerangka Pemikiran .....	27
E. Hipotesis Penelitian .....	28
BAB III METODE PENELITIAN .....	29
A. Rancangan Penelitian .....	29
B. Obyek Penelitian .....	29
C. Periode Amatan .....	29
D. Jenis Data Penelitian .....	30
E. Teknik Pengambilan Data .....	30
F. Klasifikasi Variabel Penelitian .....	30
1. Variabel Dependen .....	30
2. Variabel Independen .....	31
G. Definisi Operasional Variabel .....	31
1. <i>Return</i> Saham .....	31
2. <i>Monday Effect</i> .....	31
3. <i>Weekend Effect</i> .....	31
4. Hari Perdagangan .....	32
H. Teknik Analisis Data .....	32
1. Analisis Regresi Berganda .....	33
2. Uji Asumsi Klasik .....	34
3. Uji Hipotesis .....	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....	37
A. Hasil Penelitian .....	37
1. Statistik Deskriptif .....	37
2. Hasil Analisis Regresi Berganda .....	38
3. Hasil Uji Asumsi Klasik .....	43
4. Hasil Pengujian Hipotesis .....	44
B. Pembahasan .....	46
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....	50
A. Kesimpulan .....	50
B. Saran .....	51

DAFTAR PUSTAKA .....	52
LAMPIRAN .....	54