

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
LEMBAR PERSETUJUAN.....	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
ABSTRAK/ <i>ABSTRACT</i>	v
MOTTO	vii
HALAMAN PERSEMBAHAN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	5
C. Tujuan Penelitian	5
D. Manfaat Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
A. Landasan Teori	7
1. Investasi.....	7
2. Pasar Modal.....	8
3. <i>Efficient Market Hypothesis (EMH)</i>	9
4. Anomali Pasar: Suatu penyimpangan pasar efisien	13
5. Teori Asimetri Informasi.....	15
6. <i>Signalling Theory</i>	16
7. Teori <i>Behavioral Finance</i>	17
8. <i>Day of The Week Effect</i>	18
9. Saham.....	20
10. <i>Return</i>	22
11. Indeks LQ-45	23

B. Penelitian Terdahulu	25
C. Hubungan Antar Variabel	26
D. Kerangka Pemikiran.....	27
E. Hipotesis Penelitian.....	28
BAB III METODE PENELITIAN	29
A. Rancangan Penelitian	29
B. Populasi Penelitian	30
C. Objek Penelitian dan Periode Amatan	30
D. Jenis Data Penelitian	31
E. Variabel Penelitian dan Pengukurannya	31
<i>Return</i> Indeks	31
F. Tahapan Penelitian	33
G. Teknik Analisis Data.....	34
1. Analisis Statistik Deskriptif	34
2. Uji Asumsi Klasik.....	35
3. Analisis Regresi Linear Berganda.....	38
4. Uji Hipotesis	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	42
A. Hasil Penelitian	42
B. Pembahasan.....	52
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	57
A. Kesimpulan	57
B. Saran.....	57
 DAFTAR PUSTAKA	 59
LAMPIRAN.....	61