

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	vi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	7
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
1.5. Sistematika Penulisan.....	8
1.6. Batasan Penelitian	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	10
2.1. Landasan Teori.....	10
2.1.1. Pasar Efisien.....	10
2.1.2. Anomali Pasar	11
2.1.3. Efek Hari Perdagangan	12
2.2. Penelitian Terdahulu	13
2.3. Kerangka Penelitian	16
2.4. Pengembangan Hipotesis	18
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	20
3.1. Populasi Penelitian	20
3.2. Jenis dan Sumber Data	20
3.3. Metode dan Pengumpulan Data	21
3.4. Definisi Operasional Variabel.....	21
3.4.1. <i>Return</i>	21
3.4.2. <i>Size</i>	22
3.4.3. <i>The Day of The Week Effect</i>	22
3.5. Metode Penelitian.....	22
3.6. Metode Pengujian Statistik.....	23
3.6.1. Analisis Statistik Deskriptif.....	23
3.6.2. Uji Asumsi Normalitas	24



3.6.3.	Uji Heteroskedasitas	24
3.6.4.	Uji Multikolinearitas	25
3.6.5.	Uji Stasioneritas	25
3.7.	Metode Pengujian Hipotesis.....	26
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		29
4.1.	Deskripsi Objek Penelitian	29
4.2.	Statistik Deskriptif.....	29
4.3.	Uji Asumsi.....	32
4.3.1.	Uji Normalitas.....	32
4.3.2.	Uji Heteroskedastisitas.....	33
4.3.3.	Uji Multikolinearitas	34
4.3.4.	Uji Stasioneritas	35
4.4.	Hasil Analisis Data	36
4.4.1.	Pengujian Hipotesis 1	36
4.4.2.	Pengujian Hipotesis 2	40
4.4.3.	Pengujian Hipotesis 3	44
4.5.	Pembahasan	49
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		52
5.1.	Kesimpulan.....	52
5.2.	Keterbatasan Penelitian	53
5.3.	Saran.....	54
DAFTAR PUSTAKA		55
LAMPIRAN 1. <i>DO-FILE</i>		58
LAMPIRAN 2. HASIL REGRESI OLS.....		61
LAMPIRAN 3. HASIL ESTIMASI GARCH (1,1).....		67

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Statistik Deskriptif Indeks Harga Saham Gabungan (2011-2021)	30
Tabel 4.2. Statistik Deskriptif Indeks LQ45 (2011-2021)	31
Tabel 4.3. Statistik Deskriptif Indeks IDX SMC Composite (2011-2021).....	32
Tabel 4.4. Hasil Uji <i>White Test</i>	34
Tabel 4.5. Hasil Uji VIF	35
Tabel 4.6. Hasil Uji Akar Unit.....	35
Tabel 4.7 Hasil Regresi OLS Persamaan <i>Return</i> Harian IHSG	36
Tabel 4.8 Hasil Regresi GARCH (1,1) Persamaan <i>Return</i> Harian IHSG.....	38
Tabel 4.9 Hasil Regresi OLS Persamaan <i>Return</i> Harian Saham Indeks LQ45 ...	41
Tabel 4.10 Hasil Regresi GARCH (1,1) Persamaan <i>Return</i> Harian Indeks LQ45	42
Tabel 4.11 Hasil Regresi OLS Persamaan <i>Return</i> Harian Saham Indeks IDX SMC Composite	45
Tabel 4.12 Hasil Regresi GARCH (1,1) Persamaan <i>Return</i> Harian Indeks IDX Composite	47



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Kerangka Penelitian	17
Gambar 4.1. Hasil Uji Normalitas	33