ANALISIS PENGARUH HARI LIBUR TERHADAP PEROLEHAN RETURN DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM INDEKS HARGA
SAHAM GABUNGAN DAN INDEKS LQ45 PERIODE 2009--2017
MUHAMMAD ARIE SETIAWAN, Mamduh M. Hanafi, Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

Daftar Isi

Halaman Judul……...i

Lembar Pengesahan…….....ii

Lembar Persetujuan…….…iii

Pernyataan Keaslian Karya Tulis iv

Kata Pengantar…….……v

Daftar Isi……..….vi

Daftar Tabel……..ix

Daftar Gambar……..x

Daftar Lampiran……...xi

Intisari……...xii

***Abstract*……xiii**

BAB 1 PENDAHULUAN 1
1.1. Latar Belakang 1
1.2. Rumusan Masalah 7
1.3. Pertanyaan Penelitian 9
1.4. Tujuan Penelitian 9
1.5. Manfaat Penelitian 10
1.6. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian 10
1.7. Sistematika Penelitian 10

BAB II LANDASAN TEORI 12
2.1. Pasar Modal 12
2.2. *Return* Saham 13
2.3. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) 16
2.4. Indeks LQ45 16
2.5. Volume Perdagangan Saham 17
2.6. Pasar Efisien 19
2.7. Anomali Pasar 22
2.7.1. Efek Idul Fitri 23
2.7.2. Efek Natal 24
2.7.3. Efek tahun baru 25

ANALISIS PENGARUH HARI LIBUR TERHADAP PEROLEHAN RETURN DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM INDEKS HARGA
SAHAM GABUNGAN DAN INDEKS LQ45 PERIODE 2009--2017
MUHAMMAD ARIE SETIAWAN, Mamduh M. Hanafi, Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

2.7.4. Efek hari libur 26
2.8. Penelitian Terdahulu 27
2.8.1. Efek Idul Fitri 27
2.8.2. Efek Natal 28
2.8.3. Efek tahun baru 29
2.8.4. Efek hari libur 30
2.8.5. Perbedaan volume perdagangan 31
2.9. Pengembangan Hipotesis 32

BAB III METODE PENELITIAN 34
3.1. Populasi Penelitian 34
3.2. Data dan Sumber Data 34
3.3. Metode Pengumpulan Data 36
3.4. Perhitungan *Return* 36
3.5. Perhitungan *Detrended Volume* 37
3.6. Teknik analisis data 38
3.6.1. Analisis regresi linier berganda 38
3.6.2. Analisis uji beda 39
3.7. Uji Asumsi Klasik 40
3.7.1. Uji normalitas 40
3.7.2. Uji autokorelasi 41
3.7.3. Uji multikolinearitas 41
3.7.4. Uji heteroskedastisitas 42
3.8. Uji hipotesis 43

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 44
4.1. Statistik Deskriptif 44
4.1.1. IHSG 44
4.1.2. LQ45 45
4.1.3. Uji *one sample t-test* 47
4.1.4. Volume perdagangan 48
4.2. Hasil Uji Asumsi Klasik 49
4.2.1. Hasil uji asumsi klasik pada hipotesis 1 dan 2 49
4.2.2. Hasil uji asumsi klasik pada hipotesis 3 52
4.3. Hasil Uji Hipotesis 54
4.3.1. Hasil uji hipotesis 1 dan 2 54
4.3.2. Hasil uji hipotesis 3 54
4.3.3. Hasil uji hipotesis 4 56
4.4. Pembahasan 57
4.4.1. Hipotesis 1 57
4.4.2. Hipotesis 2 58
4.4.3. Hipotesis 3 59
4.4.4. Hipotesis 4 61

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 62

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
ANALISIS PENGARUH HARI LIBUR TERHADAP PEROLEHAN RETURN DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DAN INDEKS LQ45 PERIODE 2009--2017
MUHAMMAD ARIE SETIAWAN, Mamduh M. Hanafi, Dr., M.B.A.
Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

5.1. Kesimpulan 62
5.2. Keterbatasan Penelitian……..63
5.3. Saran……...64

Daftar Pustaka……65
Lampiran……....68