

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan.....	ii
Halaman Pernyataan.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	ix
Daftar Lampiran.....	x
Intisari.....	xi
<i>Abstract</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
1. Perumusan Masalah	3
2. Tujuan Penelitian	4
3. Manfaat Penelitian	4
B. Sistematika Penulisan	5

BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	7
A. Tinjauan Pustaka	7
1. Teori Efisiensi Pasar	7
2. Implikasi Efisien Pasar	9
3. <i>Return</i> dan Risiko Investasi (Analisis Investasi)	11
B. Tinjauan Penelitian Empirik Sebelumnya	15
C. Perumusan Hipotesis	22
BAB III METODE PENELITIAN	24
A. Desain Penelitian	24
1. Data	24
2. Populasi dan Metode Pengambilan Sampel	24
B. Pengujian Hipotesis	27
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	32
A. Gambaran Umum Penelitian	32
B. Statistik Deskriptif	33
1. Rata-rata <i>Return</i> Harian Perusahaan Besar	34
2. Rata-rata <i>Return</i> Harian Perusahaan Menengah	36
3. Rata-rata <i>Return</i> Harian Perusahaan Kecil	37
C. Pengujian Hipotesis	41
1. Pengujian Hipotesis Pertama (H_1)	41



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

DAMPAK UKURAN PERUSAHAAN (FIRM SIZE) TERHADAP DAY-OF-THE WEEK EFFECT DI BURSA EFEK JAKARTA

Patar Freddy Manurung, Sukmawati Sukamulja, Prof., Dr.

Universitas Gadjah Mada, 2008 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

2. Pengujian Hipotesis Kedua (H_2)	43
3. Pengujian Hipotesis Ketiga (H_3)	44
D. Pembahasan Hasil Penelitian	45
1. <i>Day-of-the-week effect</i>	45
2. Ukuran Perusahaan (<i>firm size</i>) berpengaruh terhadap <i>return</i> saham Di Bursa Efek Jakarta	49
3. Interaksi <i>day-of-the-week</i> dengan ukuran perusahaan (<i>firm size</i>)	50
BAB V PENUTUP	51
A. SIMPULAN	51
B. KETERBATASAN	52
C. SARAN	52

DAFTAR TABEL

Tabel 1	Rata-rata Return Harian Periode Amatan Januari 2002 s.d Desember 2007	33
Tabel 2	Rata-rata Return Harian Pada Perusahaan Besar Periode Amatan 2002 s.d 2007	35
Tabel 3	Rata-rata Return Harian Pada Perusahaan Menengah Periode Amatan 2002 s.d 2007	36
Tabel 4	Rata-rata Return Harian Pada Perusahaan Kecil Periode Amatan 2002 s.d 2007	37
Tabel 5	Akumulasi Rata-rata Return Harian Periode Amatan 2002 s.d 2007	40
Tabel 6	Uji Anova Untuk Hipotesis I, II, dan III	41
Tabel 7	Hasil Duncan's Test Terhadap Rata-rata Return Harian Berdasarkan Hari	42
Tabel 8	Hasil Duncan's Test Terhadap Rata-rata Return Harian Berdasarkan Ukuran Perusahaan	44



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**DAMPAK UKURAN PERUSAHAAN (FIRM SIZE) TERHADAP DAY-OF-THE WEEK EFFECT DI BURSA
EFEK JAKARTA**

Patar Freddy Manurung, Sukmawati Sukamulja, Prof., Dr.

Universitas Gadjah Mada, 2008 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

DAFTAR LAMPIRAN

Hasil Olah Data *Day-of-the-week effect*

Univariate Analysis of Variance