



Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan.....	iii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi.....	vii
Daftar Tabel	x
Daftar Bagan	xi
Daftar Lampiran	xii
Intisari	xiii
<i>Abstract</i>	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	6
1.7 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1 Landasan Teori.....	8
2.1.1 Return	8
2.1.2 Volatilitas	10
2.1.2 Pasar Efisien	12
2.1.2 Anomali Pasar	14
2.1.2 Efek Januari.....	16
2.1.2 Efek Hari Perdagangan.....	17
2.2 Tinjauan Pustaka	18



2.3 Pengembangan Hipotesis	20
BAB III METODE PENELITIAN	22
3.1 Desain Penelitian	22
3.2 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	22
3.2.1 Variabel dependen.....	22
3.2.1 Variabel independen.....	23
3.3 Populasi dan Sampel	24
3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	24
3.5 Teknik Analisis Data.....	24
3.6 Uji Asumsi Klasik.....	28
3.6.1 Uji normalitas.....	28
3.6.2 Uji stasioneritas.....	28
3.6.3 Uji multikolinearitas	29
3.6.4 Uji heteroskedastisitas	30
3.6.5 Uji autokorelasi.....	30
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	31
4.1 Deskripsi Objek Penelitian	31
4.2 Statistik Deskriptif	31
4.3 Pengujian Asumsi Klasik.....	32
4.3.1 Uji normalitas.....	32
4.3.2 Uji stasioneritas.....	33
4.3.3 Uji multikolinearitas	34
4.3.4 Uji heteroskedastisitas	35
4.3.5 Uji autokorelasi.....	36
4.3.6 Uji efek ARCH-LM	37
4.4 Pengujian Hipotesis	40
4.4.1 Pengujian hipotesis perbedaan hubungan <i>return</i> dan hari perdagangan.....	40
4.4.2 pengujian hipotesis perbedaan hubungan volatilitas <i>return</i> dan hari perdagangan	43



BAB V SIMPULAN	46
5.1 Simpulan	46
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	46
5.3 Implikasi	47
DAFTAR PUSTAKA	48
LAMPIRAN.....	50