



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	I
HALAMAN PENGESAHAN	II
HALAMAN PERNYATAAN	III
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN	IV
HALAMAN PERSEMBAHAN	V
KATA PENGANTAR	VIII
DAFTAR ISI	IX
DAFTAR TABEL	XII
DAFTAR GRAFIK	XIII
DAFTAR LAMPIRAN	XIV
ABSTRAKSI	XV
ABSTRACT	XVI
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. LATAR BELAKANG.....	1
1.2. RUMUSAN MASALAH	4
1.3. TUJUAN PENELITIAN	4
1.4. MANFAAT PENELITIAN	5
1.5. SISTEMATIKA PENULISAN	5
BAB II. TINJAUAN LITERATUR	7
2.1. PASAR MODAL YANG EFISIEN	7
2.2. EFEK <i>DAY OF THE WEEK</i>	10
2.3. PENELITIAN SEBELUMNYA	11
2.4. PASAR MODAL INDONESIA.....	15
2.5. PENGEMBANGAN HIPOTESIS	19



2.5.1. KETERKAITAN EFEK DAY OF THE WEEK DENGAN IMBAL HASIL.....	19
2.5.2. KETERKAITAN EFEK DAY OF THE WEEK DENGAN VOLATILITAS IMBAL HASIL	19
BAB III. METODOLOGI PENELITIAN.....	21
3.1. JENIS DAN SUMBER DATA.....	21
3.2. METODE PENGAMBILAN SAMPEL.....	22
3.3. VARIABEL PENELITIAN DAN DEFINISI OPERASIONAL	22
3.3.1. VARIABEL DEPENDEN	22
3.3.2. VARIABEL INDEPENDEN.....	23
3.4. METODE ANALISIS DATA	24
3.5. METODE PENGUJIAN HIPOTESIS	27
BAB IV. ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	31
4.1. DESKRIPSI OBJEK PENELITIAN	31
4.2. STATISTIK DESKRIPTIF	31
4.3. PENGUJIAN ASUMSI KLASIK	34
4.3.1. UJI NORMALITAS	34
4.3.2. UJI STASIONERITAS.....	35
4.3.3. UJI MULTIKOLINEARITAS	35
4.3.4. UJI HETEROSKEDASTISITAS.....	36
4.3.5. UJI OTOKORELASI.....	37
4.3.6. UJI EFEK ARCH-LM.....	38
4.4. PENGUJIAN HIPOTESIS	41
4.4.1. PENGUJIAN HIPOTESIS HUBUNGAN IMBAL HASIL DAN HARI PERDAGANGAN.....	44



4.4.2. <i>PENGUJIAN HIPOTESIS HUBUNGAN VOLATILITAS IMBAL</i>	
<i>HASIL DAN HARI PERDAGANGAN</i>	47
4.5. DISKUSI DAN IMPLIKASI	49
BAB V. SIMPULAN DAN SARAN	51
5.1. KESIMPULAN	51
5.2. KETERBATASAN PENELITIAN	52
5.3. SARAN	53
DAFTAR PUSTAKA	55
LAMPIRAN	56