



DAFTAR ISI

| | |
|---------------------------------------|------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| LEMBAR PENGESAHAN | ii |
| LEMBAR PERSETUJUAN | iii |
| PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS | iv |
| KATA PENGANTAR | v |
| DAFTAR ISI | vi |
| DAFTAR TABEL | x |
| DAFTAR LAMPIRAN | xi |
| INTISARI | xii |
| ABSTRACT | xiii |
| BAB I | 1 |
| PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1. Latar Belakang | 1 |
| 1.2. Rumusan Masalah | 5 |
| 1.3. Tujuan Penelitian | 5 |
| 1.4. Manfaat Penelitian | 6 |
| 1.4.1. Manfaat Secara Teoritis | 6 |
| 1.4.2. Manfaat Secara Praktis | 6 |



| | |
|----------------------------------------------------------|-----------|
| 1.5. Sistematika Penulisan | 6 |
| BAB II | 8 |
| LANDASAN TEORI DAN PERUMUSAN HIPOTESIS | 8 |
| 2.1. Investasi | 8 |
| 2.2. Pasar Modal | 9 |
| 2.3. Saham | 10 |
| 2.3.1. Indeks LQ-45 | 11 |
| 2.4. Teori Pasar Efisien dan Anomali Pasar Efisien | 12 |
| 2.4.1. Teori Pasar Efisien..... | 12 |
| 2.4.2. Anomali Pasar Efisien..... | 13 |
| 2.5. Day-of-the-Week Effect dan Monday Effect..... | 15 |
| 2.6. Hipotesis Penelitian | 20 |
| BAB III | 21 |
| METODE PENELITIAN | 21 |
| 3.1. Jenis dan Sumber Data..... | 21 |
| 3.1.1. Jenis Data..... | 21 |
| 3.1.2. Sumber Data | 21 |
| 3.2. Populasi dan Sampel..... | 22 |
| 3.2.1. Populasi..... | 22 |
| 3.2.2. Sampel | 22 |



| | | |
|------------------------------------|-------------------------------------------------------------|----|
| 3.3. | Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel | 24 |
| 3.3.1. | Variabel Terikat (Dependen) | 24 |
| 3.3.2. | Variabel Bebas (Independen)..... | 25 |
| 3.4. | Metode Analisis Data..... | 25 |
| 3.4.1. | Pengolahan Data Awal..... | 26 |
| 3.4.2. | Uji Asumsi Klasik | 27 |
| 3.4.3. | Analisis Regresi | 29 |
| 3.4.4. | Pengujian Hipotesis | 32 |
| BAB IV | | 35 |
| ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN | | 35 |
| 4.1. | Deskripsi Sampel Penelitian | 35 |
| 4.2. | Uji Asumsi Klasik | 38 |
| 4.2.1. | Uji Normalitas | 38 |
| 4.2.2. | Uji Heteroskedastisitas..... | 39 |
| 4.2.3. | Uji Autokorelasi..... | 41 |
| 4.2.4. | Uji Multikolinearitas..... | 41 |
| 4.3. | Pengujian Hipotesis | 42 |
| 4.3.1. | Pengujian Dengan Model Regresi | 42 |
| 4.3.2. | Pengujian Dengan Metode Statistika (ANOVA)..... | 46 |
| 4.4. | Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis | 51 |



| | |
|-------------------------------------------------|----|
| BAB V | 54 |
| KESIMPULAN DAN IMPLIKASI PEMBAHASAN | 54 |
| 5.1. Kesimpulan | 54 |
| 5.2. Implikasi Manajerial | 55 |
| 5.3. Keterbatasan Penelitian..... | 55 |
| 5.4. Saran Untuk Penelitian Selanjutnya..... | 56 |
| DAFTAR PUSTAKA | 57 |
| LAMPIRAN | 59 |