

## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Persetujuan Pembimbing .....	ii
Halaman Pengesahan .....	iii
Halaman Motto dan Persembahan .....	iv
Pernyataan Keaslian Karya Tulis Skripsi.....	v
Pernyataan Persetujuan Unggah Karya Tulis Skripsi .....	vi
Abstraksi .....	vii
Abstract .....	viii
Kata Pengantar .....	ix
Daftar Isi.....	xii
Daftar Tabel .....	xv
Daftar Gambar.....	xvi
DaftarLampiran.....	xvii
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang .....	1
B. Rumusan Masalah .....	7
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	8
<b>BAB II LANDASAN TEORI .....</b>	<b>10</b>

A. Pasar Modal.....	10
B. Investasi.....	10
C. Saham .....	11
D. Pasar Modal Efisien.....	12
E. Anomali Pasar .....	13
F. Penelitian Terdahulu.....	16
G. Kerangka Teoritis.....	17
H. Pengembangan Hipotesis.....	18
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>19</b>
A. Jenis Penelitian .....	19
B. Ukuran Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel .....	19
C. Jenis dan Sumber Data Penelitian .....	20
D. Teknik Pengumpulan Data .....	20
E. Variabel dan Pengukuran .....	20
F. Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis .....	21
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>25</b>
A. Hasil Pengumpulan Data Penelitian .....	25
B. Statistik Deskriptif dan pengujian asumsi klasik .....	26
1. Statistik Deskriptif .....	26
2. Uji Asumsi Klasik.....	26
a. Uji Normalitas.....	26
b. Uji Multikolinearitas.....	27
c. Uji Heteroskedastisitas.....	28

d. Uji Autokorelasi.....	29
3. Hasil Pengujian Hipotesis.....	30
C. Pembahasan Hasil Penelitian.....	31
D. Implikasi.....	32
BAB V SIMPULAN,KETERBATASAN DAN SARAN .....	33
A. Simpulan.....	33
B. Keterbatasan dan Saran .....	33

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	17
Tabel 4.1 Perincian Daftar Sampel .....	25
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Sebelum Terpenuhi Asumsi Klasik .....	26
Tabel 4.3 <i>Normalitas Kolmogorov-Smirnov</i> .....	27
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas .....	27
Tabel 4.5 Uji Heteroskedastisitas Glejser .....	28
Tabel 4.6 Hasil <i>Durbin-Watson</i> setelah transformasi... ..	29
Tabel 4.7 Hasil Regresi Linier dengan <i>Dummy</i> ... ..	30

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik rata-rata <i>return</i> LQ45 menjelang hari libur Natal.....	4
Gambar 1.2 Grafik rata-rata <i>return</i> LQ45 menjelang hari libur Paskah.....	5
Gambar 1.3 Grafik rata-rata <i>return</i> LQ45 setelah hari libur Natal.....	5
Gambar 1.4 Grafik rata-rata <i>return</i> LQ45 setelah hari libur Paskah.....	6
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	16

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Sampel Perusahaan LQ45

Lampiran 2 Data *Return* Sampel Perusahaan LQ45

Lampiran 3 Data Statistik Deskriptif Sebelum Transformasi Data

Lampiran 4 Data Statistik Deskriptif Setelah Transformasi Data

Lampiran 5 Hasil Uji Normalitas Sebelum Transformasi Data

Lampiran 6 Hasil Uji Normalitas Setelah Transformasi Data

Lampiran 7 Hasil uji Multikolinearitas

Lampiran 8 Hasil Uji Heteroskedastisitas

Lampiran 9 Hasil Uji Autokorelasi Sebelum Transformasi Data

Lampiran 10 Hasil Uji Autokorelasi Setelah Transformasi Data

Lampiran 11 Hasil Pengolahan Persamaan Regresi Berganda *With Dummy*

Lampiran 12 Kartu Bimbingan Skripsi.