

DAFTAR ISI

| | |
|--|------|
| SKRIPSI | i |
| HALAMAN PENGESAHAN | ii |
| HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS | ii |
| HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIK | iv |
| KATA PENGANTAR | v |
| ABSTRAK | vii |
| ABSTRACT | viii |
| DAFTAR ISI | ix |
| DAFTAR TABEL | xi |
| DAFTAR GAMBAR | xii |
| BAB I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian | 1 |
| 1.2. Latar Belakang Penelitian | 2 |
| 1.3. Perumusan Masalah | 6 |
| 1.4. Tujuan Penelitian | 7 |
| 1.5. Manfaat Penelitian | 7 |
| 1.5.1. Aspek Teoritis | 7 |
| 1.5.2. Aspek Praktis | 8 |
| 1.6. Sistematika Penulisan Tugas Akhir | 8 |
| BAB II TINJAUAN PUSTAKA | 10 |
| 2.1. Teori dan Penelitian Terdahulu..... | 10 |
| 2.1.1. Tinjauan Pustaka Penelitian | 10 |
| 2.1.1.1. Pasar Efisien..... | 10 |
| 2.1.1.2. Anomali Pasar | 11 |
| 2.1.1.3. Investasi | 14 |
| 2.1.1.4. Pasar Modal | 15 |
| 2.1.1.5. Saham..... | 16 |
| 2.1.1.6. Return saham | 16 |
| 2.1.1.7. Penelitian Terdahulu | 17 |
| 2.2. Kerangka Pemikiran..... | 31 |
| 2.2.1. <i>The Day of The Week Effect</i> | 31 |
| 2.2.2. <i>Rogalsky Effect</i> | 31 |

| | |
|--|-----------|
| 2.3. Hipotesis Penelitian..... | 32 |
| BAB III METODE PENELITIAN | 33 |
| 3.1. Jenis Penelitian..... | 33 |
| 3.2. Operasionalisasi Variabel | 34 |
| 3.3. Tahapan Penelitian..... | 34 |
| 3.4. Populasi dan Sampel | 37 |
| 3.5. Pengumpulan Data dan Sumber Data | 39 |
| BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... | 43 |
| 4.1. Hasil Penelitian | 43 |
| 4.1.1. Statistik Dekskriptif | 43 |
| 4.1.2. <i>The Day of The Week Effect</i> | 45 |
| 4.1.3. <i>Rogalsky Effect</i> | 48 |
| 4.2. Pembahasan Hasil Penelitian | 51 |
| 4.2.1. <i>The Day of The Week Effect</i> | 51 |
| 4.2.2. <i>Rogalsky Effect</i> | 52 |
| BAB V KESIMPULAN DAN SARAN | 54 |
| 5.1. Kesimpulan | 54 |
| 5.2. Implikasi | 54 |
| 5.3. Saran | 55 |
| DAFTAR PUSTAKA..... | 56 |
| Lampiran | 59 |