

DAFTAR ISI

	Halaman
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN DRAFT SKRIPSI	ii
<i>ABSTRACT</i>	iii
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	10
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	11
1. Tujuan Penelitian.....	11
2. Kontribusi Penelitian.....	11
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS.....	12
A. Kajian Pustaka.....	12
1. Teori Agensi (<i>Agency Theory</i>)	12
2. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	13
3. <i>Return Saham</i>	14
a. Definisi <i>Return Saham</i>	14
b. Jenis-jenis <i>Return Saham</i>	15
c. Komponen <i>Retur Saham</i>	16
4. Anomali Pasar	16
a. Definisi Anomali Pasar	16
b. Macam-macam Anomali Pasar	17

5. <i>Monday effect</i>	22
6. <i>Friday effect</i>	23
7. <i>Rogalsky efect</i>	24
B. Penelitian yang Relavan	24
C. Rerangka Pemikiran	31
1. Pengaruh <i>Monday effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	31
2. Pengaruh <i>Friday effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	33
3. Pengaruh <i>Rogalsky effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	33
D. Hipotesis.....	34
 BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	35
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	35
B. Desain Penelitian	35
C. Definisi, Operasional dan Pengukuran Variabel.....	36
1. Variabel Dependenden : <i>Return Saham</i>	36
2. Variabel Independen : Variabel bebas	36
D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	41
1. Populasi Penelitian	41
2. Sampel Penelitian	41
E. Teknik Pengumpulan Data.....	42
F. Metode Analisis	43
1. Analisis Statistik Deskriptif	43
2. Uji Asumsi Klasik	43
a. Uji Normalitas	44
b. Uji Heteroskedastisitas	44
c. Uji Multikolinearitas	45
d. Uji Autokorelasi	46
3. Pengujian Hipotesis.....	47
a. Koefisien Determinasi (R^2)	47
b. Uji signifikan Simultan (Uji Statistik f)	48
c. Uji Signifikasi Parsial (Uji Statistik t)	48

d. Uji Analisis Regresi Berganda	49
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	51
A. Gambaran Umum Perusahaan	51
B. Hasil Uji Statistik Deskriptif	51
C. Uji Asumsi Klasik.....	54
1. Uji Normalitas.....	54
2. Uji Heteroskedastisitas	56
3. Uji Multikolinearitas	58
4. Uji Autokorelasi	59
D. Uji Hipotesis Penelitian	60
1. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	60
2. Uji Signifikan Simultan (Uji Statistik F)	62
3. Uji Signifikan Parsial (Uji Statistik t).....	63
4. Uji Analisis Regresi Berganda.....	68
E. Pembahasan	70
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	72
A. Simpulan	72
B. Saran	73
DAFTAR PUSTAKA.....	75
LAMPIRAN	77