

## DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR .....	i
DAFTAR ISI.....	iii
DAFTAR TABEL.....	vi
DAFTAR GAMBAR .....	viii
BAB I	
PENDAHULUAN .....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Identifikasi dan Rumusan Masalah.....	10
1.2.1. Identifikasi Masalah.....	10
1.2.2. Rumusan Masalah.....	10
1.3. Maksud dan Tujuan Penelitian .....	11
1.3.1. Maksud Penelitian.....	11
1.3.2. Tujuan Penelitian .....	11
1.4. Kegunaan Penelitian .....	12
1.4.1. Kegunaan Praktis .....	12
1.4.2. Kegunaan Akademis .....	12
1.5. Lokasi dan Waktu Penelitian.....	13
1.5.1. Lokasi Penelitian.....	13
1.5.2. Waktu Penelitian.....	14
BAB II	
KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS .....	15
2.1. Kajian Pustaka .....	15
2.1.1. <i>Monday Effect</i> .....	15
2.1.2. <i>Week-Four Effect</i> .....	16
2.1.3. <i>Rogalski Effect</i> .....	17
2.1.4. Indeks SRI-KEHATI .....	18
2.1.5. <i>Return Saham</i> .....	20
2.1.6. Indeks Saham.....	22
2.1.7. Saham.....	22
2.1.8. Pasar Efisien .....	24
2.1.9. Anomali Pasar.....	26

2.1.10.	Penelitian Terdahulu .....	29
2.2.	Kerangka Pemikiran .....	32
2.2.1.	Pengaruh <i>Monday Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	34
2.2.2.	Pengaruh <i>Week-Four Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	34
2.2.3.	Pengaruh <i>Rogalski Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	35
2.2.4.	Pengaruh <i>Monday Effect, Week-Four Effect, Dan Rogalski Effect</i> Terhadap <i>Return Saham</i> .....	35
2.3.	Hipotesis .....	37
<b>BAB III</b>		
<b>METODOLOGI PENELITIAN</b> .....		
3.1.	Objek Penelitian .....	38
3.2.	Metode Penelitian .....	38
3.1.1.	Desain Penelitian .....	39
3.1.2.	Operasional Variabel .....	43
3.1.3.	Sumber dan Teknik Penentuan Data.....	44
3.1.4.	Teknik Pengumpulan Data.....	47
3.1.5.	Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis.....	48
<b>BAB IV</b>		
<b>HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b> .....		
4.1.	Gambaran Umum Perusahaan .....	66
4.2.	Analisis Deskriptif .....	71
4.2.1.	<i>Monday Effect</i> .....	71
4.2.2.	<i>Week-four Effect</i> .....	81
4.2.3.	<i>Rogalski Effect</i> .....	89
4.2.4.	<i>Return Saham</i> .....	98
4.3.	Analisis Verifikatif .....	105
4.4.	Pengujian Hipotesis .....	113
4.4.1.	Analisis uji t .....	113
4.4.2.	Analisis uji F .....	118
4.4.3.	Analisis Korelasi.....	120
4.4.4.	Analisis Koefisien Determinasi .....	123
4.4.5.	Rekapitulasi Hasil Uji Hipotesis.....	125

## BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN.....	127
5.1. Kesimpulan.....	127
5.2. Saran.....	128
DAFTAR PUSTAKA .....	129
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	136