DAFTAR ISI

JUDUL i

PENGESAHAN ii

ABSTRAK iii

ABSTRACT iv

KATA PENGANTAR v

DAFTAR ISI vii

DAFTAR TABEL x

DAFTAR GAMBAR xi

DAFTAR GRAFIK xii

DAFTAR LAMPIRAN xiii

BAB I : PENDAHULUAN 1

A. Latar Belakang Masalah 1

B. Identifikasi Masalah 4

C. Batasan Masalah 5

D. Batasan Penelitian 6

E. Rumusan Masalah 6

F. Tujuan Penelitian 7

G. Manfaat Penelitian 7

BAB II : KAJIAN PUSTAKA 9

A. Landasan Teoritis 9

1. Pasar Efisien 9

2. Event Study 12

3. Trading Volume Activity 13

4. Anomali Pasar 14

a. Pengertian Anomali Pasar 14

b. Jenis-Jenis Anomali 15

5. The Day of The Week Effect 17

6. Saham 18

7. Return Saham 20

8. Prediksi Potensi Return Positif atau Negatif 21

B. Penelitian Terdahulu 22

C. Kerangka Pemikiran 30

D. Hipotesis 31

BAB III : METODE PENELITIAN 31

A. Objek Penelitian 32

B. Desain Penelitian 32

C. Variabel Penelitian 33

1. Return Saham 33

2. Volume Perdagangan 35

D. Teknik Pengumpulan Data 36

E. Teknik Pengambilan Sampel 36

F. Teknik Analisis Data 38

1. Analisis Deskriptif 38

2. Uji Beda T-test dengan Sampel Berpasangan 39

3. Uji Regresi Logistik 40

BAB IV : HASIL ANALISIS PEMBAHASAN 43

A. Gambaran Umum Objek Penelitian 43

B. Analisis Deskriptif 43

1. Return Open-Close 44

2. Return Close-Close 45

3. Volume 46

C. Hasil Penelitian 47

1. Uji Paired T-test 47

a. Return Open-Close 47

b. Return Close-Close 48

c. Volume Perdagangan (Shares) 49

2. Uji Regresi Logistik 50

D. Pembahasan 54

1. Pembahasan Hipotesa Pertama 54

2. Pembahasan Hipotesa Kedua 54

3. Pembahasan Hipotesa Ketiga 55

4. Pembahasan Hipotesa Keempat 55

5. Pembahasan Hipotesa Kelima 55

6. Pembahasan Hipotesa Keenam 56

7. Pembahasan Hipotesa Ketujuh 56

8. Pembahasan Hipotesa Kedelapan 56

BAB V : SIMPULAN DAN SARAN 57

A. Simpulan 57

B. Saran 57

DAFTAR PUSTAKA 59

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Return Saham Mingguan 2017 PT Telekomunikasi Indoneisa TBK 3

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu 22

Tabel 3.1 Return Day 35

Tabel 3.2 Sampel Penelitian 37

Tabel 3.3 Hipotesis 39

Tabel 3.4 Tabel Koefisien Model Logistic 42

Tabel 4.1 Hasil Paired T-testb Return Open-Close (Ro-c) 47

Tabel 4.2 Hasil Paired T-test Return Close-Close(Rc-c) 48

Tabel 4.3 Hasil Paired T-test Volume Perdagangan(Shares) 49

Tabel 4.4 Tabel Koefisien Model Regresi Logistik 50

Tabel 4.5 Tabel Estimasi Kemungkinan Return Positif Negatif 53

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Penelitian 30

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 Return Open-Close 44

Grafik 4.2 Return Close-Close 45

Grafik 4.3 Volume (Shares) 46

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Perusahaan Sampel Penelitian 63

Lampiran 2 Contoh Data Sampel Perushaan 64

Lampiran 3 Hasil Uji 72

1. Uji Beda Return Open-Close 72

2. Uji Beda Return Close-Close 73

3. Uji Beda Volume (Shares) 75

4. Uji Logit Return Open-Close 76

5. Uji Logit Return Close-Close 80