# DAFTAR ISI

[PENGESAHAN ii](#_Toc9886051)

[ABSTRAK iii](#_Toc9886052)

[ABSTRACT iv](#_Toc9886053)

[KATA PENGANTAR v](#_Toc9886054)

[DAFTAR ISI vii](#_Toc9886055)

[DAFTAR TABEL x](#_Toc9886056)

[DAFTAR GRAFIK xi](#_Toc9886057)

[DAFTAR LAMPIRAN xii](#_Toc9886058)

[BAB I PENDAHULUAN 1](#_Toc9886059)

[A. Latar Belakang Masalah 1](#_Toc9886061)

[B. Identifikasi Masalah 7](#_Toc9886062)

[C. Batasan Masalah 8](#_Toc9886063)

[D. Batasan Penelitian 8](#_Toc9886064)

[E. Rumusan Masalah 9](#_Toc9886065)

[F. Tujuan Penelitian 9](#_Toc9886066)

[G. Manfaat Penelitian 10](#_Toc9886067)

[BAB II KAJIAN PUSTAKA 11](#_Toc9886068)

[A. Landasan Teori 11](#_Toc9886070)

[**1.** **Pasar Modal Efisien** 11](#_Toc9886071)

[**2.** **Bentuk Pasar Efisien** 12](#_Toc9886072)

[**3.** **Anomali Pasar** 13](#_Toc9886073)

[**4.** **Return Saham** 18](#_Toc9886074)

[**5.** **Volume Perdagangan** 19](#_Toc9886075)

[**6.** **Prediksi potensi *return* positif dan *return* negatif** 20](#_Toc9886076)

[B. Penelitian Terdahulu 21](#_Toc9886077)

[C. Kerangka Pemikiran 23](#_Toc9886078)

[D. Hipotesis 24](#_Toc9886079)

[BAB III METODE PENELITIAN 25](#_Toc9886080)

[A. Objek Penelitian 25](#_Toc9886082)

[B. Metode dan Desain Penelitian 25](#_Toc9886083)

[C. Variable Penelitian 27](#_Toc9886084)

[**(1)** **Return Open-Close (ROC)** 27](#_Toc9886085)

[**(2)** **Return Close-Close (RCC)** 27](#_Toc9886086)

[**(3)** **Volume Perdagangan (*shares*)** 28](#_Toc9886087)

[D. Teknik Pengumpulan Data 28](#_Toc9886088)

[E. Teknik Pengambilan Sampel 29](#_Toc9886089)

[F. Teknik Analisis Data 29](#_Toc9886090)

[BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN 35](#_Toc9886091)

[A. Gambaran Umum Objek Penelitian 35](#_Toc9886092)

[B. Analisis Deskriptif 36](#_Toc9886093)

[**Grafik 4.1** 36](#_Toc9886094)

[**Grafik 4.2** 37](#_Toc9886095)

[**Grafik 4.3** 38](#_Toc9886096)

[C. Hasil Penelitian 39](#_Toc9886097)

[**1.** **Uji Paired T-Test** 39](#_Toc9886098)

[**2.** **Uji Logistic Regression** 42](#_Toc9886099)

[D. Pembahasan 46](#_Toc9886100)

[**a. Pembahasan analisis hipotesis 1 46**](#_Toc9886101)

[**b. Pembahasan analisis hipotesis 2 46**](#_Toc9886102)

[**c. Pembahasan analisis hipotesis 3 46**](#_Toc9886103)

[**d. Pembahasan analisis hipotesis 4 47**](#_Toc9886104)

[**e. Pembahasan analisis hipotesis 5 47**](#_Toc9886105)

[**f. Pembahasan analisis hipotesis 6 47**](#_Toc9886106)

[**g. Pembahasan analisis hipotesis 7 47**](#_Toc9886107)

[**h. Pembahasan analisis hipotesis 8 48**](#_Toc9886108)

[BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 49](#_Toc9886109)

[A. Kesimpulan 49](#_Toc9886110)

[B. Saran 49](#_Toc9886111)

[DAFTAR PUSTAKA 51](#_Toc9886112)