DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN..... iii

HALAMAN PERNYATAAN..... iv

KATA PENGANTAR..... v

ABSTRAK..... vii

ABSTRACT..... viii

DAFTAR ISI..... ix

DAFTAR TABEL..... xii

DAFTAR GAMBAR..... xiii

DAFTAR LAMPIRAN..... xiv

BAB I PENDAHULUAN..... 1

1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian..... 1

1.2 Latar Belakang Penelitian..... 2

1.3 Perumusan Masalah..... 9

1.4 Pertanyaan Penelitian..... 10

1.5 Tujuan Penelitian..... 10

1.6 Manfaat Penelitian..... 10

1.7 Ruang Lingkup Penelitian..... 11

1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir..... 11

BAB II TINJAUAN PUSTAKA..... 13

2.1 Teori yang Terkait Penelitian dan Penelitian Terdahulu..... 17

2.1.1 Investasi..... 17

2.1.2 Pasar Modal……..... 17

2.1.3 Saham……..... 14

2.1.4 *Asymmetric Information*…… 17

2.1.5 Pasar Efisien……..... 17

2.2 Penelitian Terdahulu..... 20

2.3 Kerangka Pemikiran..... 25

2.4 Hipotesis Penelitian…… 25

BAB III METODE PENELITIAN..... 26

3.1 Karakteristik Penelitian..... 26

3.2 Alat Pengumpulan Data..... 27

3.2.1 Variabel Penelitian..... 27

3.3 Tahapan Penelitian..... 30

3.4 Populasi dan Sampel..... 32

3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data..... 34

3.6 Teknik Analisis Data……..…..... 34

3.6.1 Teknik Analisis Data……..... 34

3.6.2 Pengujian Hipotesis..... 35

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN..... 37

4.1 Karakteristik Penelitian……..... 37

4.2 Hasil Penelitian……..... 37

4.2.1 Deskripsi Variabel *Return* Saham……..... 37

4.2.2 Pengujian Hipotesis……..... 41

4.3 Analisis dan Pembahasan..... 43

4.3.1 *The Day-of-The-Week Effect* pada Indeks Kompas100……..... 43

4.3.2 *The Day-of-The-Week Effect* pada *Straits Times Index*……..... 46

4.3.3 Volatilitas Harga Saham……..... 48

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN..... 51

5.1 Kesimpulan..... 51

5.2 Saran..... 52

5.2.1 Aspek Teoritis..... 52

5.2.2 Aspek Praktis..... 52

DAFTAR PUSTAKA..... 56