

## DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN

LEMBAR PENGESAHAN

PERNYATAAN PLAGIAT

BIOGRAFI PENULIS

MOTTO DAN PERSEMBAHAN

ABSTRAK

KATA PENGANTAR.....	i
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL .....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang Penelitian .....	1
B. Identifikasi Masalah .....	11
C. Rumusan Masalah .....	12
D. Tujuan Penelitian .....	13
E. Kegunaan Penelitian.....	14
F. Kerangka Penelitian .....	15
G. Hipotesis.....	23
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>25</b>
A. Manajemen .....	25
B. Manajemen Keuangan .....	28
C. Pasar Modal .....	33

D. <i>Efficient Market Hypothesis</i> .....	37
E. <i>Market Anomalies</i> .....	43
F. <i>Calendar Effect</i> .....	46
G. <i>Return Saham</i> .....	52
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN</b> .....	<b>53</b>
A. Metode Penelitian.....	53
B. Jenis dan Sumber Data .....	54
C. Populasi dan Sampel .....	55
D. Operasionalisasi Variabel Penelitian .....	58
E. Teknik Pengumpulan Data .....	61
F. Teknik Pengolahan Data .....	62
G. Teknik Analisis Data .....	62
H. Jadwal Penelitian .....	70
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b> .....	<b>71</b>
A. Gambaran Umum Perusahaan .....	71
B. Hasil Penelitian .....	80
1. Pengujian Asumsi Klasik .....	80
2. Pengujian Statistik Deskriptif .....	85
3. Pengujian Hipotesis .....	87
4. Koefisien Determinasi .....	100
C. Pembahasan .....	100
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b> .....	<b>106</b>
A. Kesimpulan .....	106

B. Saran .....	108
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>113</b>
<b>LAMPIRAN-LAMPIRAN</b>	



## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 <i>Return</i> Harian IHSG Pertambangan bulan September .....	5
Tabel 1.2 <i>Return</i> Harian Perusahaan Sektor Pertambangan 2017 .....	6
Tabel 1.3 Penelitian Terdahulu .....	21
Tabel 2.1 Fungsi Manajemen Menurut Para Ahli .....	28
Tabel 2.2 Instrumen Pasar Modal di Indonesia .....	36
Tabel 2.3 Hubungan Bentuk Efisiensi Pasar dengan Informasi .....	41
Tabel 2.4 Jenis-Jenis <i>Market Anomalies</i> .....	45
Tabel 3.1 Daftar Populasi Penelitian .....	55
Tabel 3.2 Seleksi Sampel Penelitian .....	57
Tabel 3.3 Sampel Penelitian .....	57
Tabel 3.4 Hari Libur Nasional 2017 .....	59
Tabel 3.5 Operasional Variabel Penelitian .....	60
Tabel 3.6 Pedoman Interpretasi Koefisien Korelasi .....	69
Tabel 4.1 Output Uji <i>One Sample Kolmogorov Smirnov</i> .....	82
Tabel 4.2 Output Uji <i>Glesjer</i> .....	83
Tabel 4.3 Output Uji Multikolinearitas .....	84
Tabel 4.4 Output Uji <i>Runs Test</i> .....	85
Tabel 4.5 Output Analisis Statistik Deskriptif .....	86
Tabel 4.6 Output Uji <i>One Sample Kolmogorov Smirnov</i> .....	87
Tabel 4.7 Output Uji <i>One Sample Kolmogorov Smirnov</i> .....	89
Tabel 4.8 Output Uji <i>Independent Sample T-test</i> .....	90
Tabel 4.9 Output Uji <i>One Sample Kolmogorov Smirnov</i> .....	93

Tabel 4.10 Output Uji <i>Independent Sample T-test</i> .....	94
Tabel 4.11 Output Uji Parsial (T-test).....	96
Tabel 4.12 Output Uji <i>Excluded Variabel</i> .....	96
Tabel 4.13 Output Uji Simultan (F-Test).....	99
Tabel 4.14 Output Koefisien Determinasi .....	100



## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 <i>Return</i> Harian <i>Pre-holiday</i> dan <i>Post-holiday</i> .....	8
Gambar 1.2 Perkembangan Kapitalisasi Pasar Modal 2017 .....	9
Gambar 1.3 Perkembangan Indeks Pertambangan 2017 .....	10
Gambar 1.4 Kerangka Penelitian .....	20
Gambar 2.1 Aliran Dana dan Efek pada Pasar Modal .....	34
Gambar 2.2 Bentuk Efisiensi Pasar Modal .....	41
Gambar 4.1 Output <i>Normal Probability Plot</i> Uji Normalitas .....	81

