

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN

LEMBAR PENGESAHAN

SURAT PERNYATAAN

BIOGRAFI

MOTO

ABSTRAK

KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah	6
C. Rumusan Masalah	7
D. Tujuan Penelitian	7
E. Kegunaan Penelitian	8
F. Kerangka Pemikiran	9
G. Hipotesis	17
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	18
A. Manajemen	18
1. Definisi Manajemen	18
2. Fungsi Manajemen	18
B. Manajemen Keuangan	19
1. Definisi Manajemen Keuangan	19
2. Tujuan Manajemen Keuangan	21
3. Fungsi Manajemen Keuangan	22
C. Pasar Modal	24

1. Definisi Pasar Modal	24
2. Fungsi Pasar Modal	25
3. Instrumen Pasar Modal	26
D. Efisiensi Pasar Modal	31
1. Definisi Efisiensi Pasar Modal	31
2. Syarat untuk Menjadi Pasar Efisien.....	31
3. Bentuk Efisiensi Pasar	32
E. Anomali Pasar	36
1. Definisi Anomali Pasar	36
2. Macam-macam Anomali Pasar	37
F. <i>Day of The Week Effect</i>	38
1. Definisi <i>Day of The Week Effect</i>	38
G. <i>Monday Effect</i>	39
1. Definisi <i>Monday Effect</i>	39
H. <i>Weekend Effect</i>	40
1. Definisi <i>Weekend Effect</i>	40
2. Faktor-faktor Penyebab <i>Weekend Effect</i>	41
I. <i>Return</i>	43
1. Definisi <i>Return</i> Saham	43
2. Faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	43
J. Indeks LQ 45	44
1. Definisi Indeks Harga Saham	44
2. Syarat Masuk Indeks LQ 45	45
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	47
A. Metode Penelitian	47
B. Populasi dan Sampel Penelitian	49
1. Populasi Penelitian	49
2. Sampel Penelitian	52
C. Jenis dan Sumber Data	54

D. Variabel Penelitian	54
1. Variabel Terikat	54
2. Variabel Bebas	55
E. Teknik Pengumpulan Data	57
F. Teknik Analisis Data	58
1. Uji Asumsi Klasik	58
2. Statistik Deskriptif	61
3. Uji Beda	62
4. Analisis Regresi	62
5. Uji Hipotesis	63
6. Koefisien Determinasi (R^2)	64
G. Jadwal dan Tempat Penelitian	65
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	67
A. Gambaran Umum	67
B. Hasil Penelitian	75
1. Hasil Uji Asumsi Klasik	75
2. Hasil Analisis Statistik Deskriptif	81
3. Hasil Uji Hipotesis	82
C. Pembahasan	91
BAB V PENUTUP	96
A. Simpulan	96
B. Saran	98
DAFTAR PUSTAKA	104
LAMPIRAN-LAMPIRAN	