



Isi	Halaman
ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	7
1.3 Tujuan penelitian.....	7
1.4 Manfaat penelitian.....	8
1.5 Sistematika penulisan.....	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Pasar Modal.....	12
2.2 Konsep Pasar Efisien.....	15
2.3 Anomali Pasar	19
2.4 <i>Day of the week effect</i>	21
2.5 <i>Rogalsky Effect</i>	23
2.6 Saham	24
2.7 Return Saham	28
2.8 Saham dalam Pandangan Islam.....	29
2.9 Tinjauan Penelitian Terdahulu	32
2.10 Kerangka Pemikiran.....	41
2.11 Hipotesis.....	42
BAB III METODE PENELITIAN	45
3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian	45
3.2 Populasi Dan Sampel	45
3.3 Jenis dan Sumber Data	47
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	47
3.5 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	48
3.6 Metode Analisis Data.....	50
3.6.1 Analisis Deskriptif	50
3.6.2 Uji Asumsi Klasik	50
3.6.2.2 Uji Normalitas	51

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan karyanya.
 - b. Pengutipan tidak mengujakan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.



Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang	
1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:	
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.	
b. Pengutipan tidak mengujikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.	
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.	
© Hak cipta milik UIN Suska Riau	
BAB IV GAMBARAN UMUM PERUSAHAAN	55
3.6.3 Analisis Regresi Linier Berganda	51
3.7 Pengujian Hipotesis	53
3.7.1 Uji Statistik T	53
3.7.2 Uji <i>Paired t-test</i>	53
4.1 Bursa Efek Indonesia	55
4.2 Indeks IDX30	58
4.3 Adhi Karya (Persero) Tbk (ADHI)	59
4.4 Adaro Energy Tbk (ADRO)	60
4.5 AKR Corporindo Tbk (AKRA)	61
4.6 Astra International Tbk (ASII)	62
4.7 Alam Sutera Realty Tbk (ASRI)	63
4.8 Bank Central Asia Tbk (BBCA)	64
4.9 Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk (BBNI)	65
4.10 Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk (BBRI)	65
4.11 Bank Mandiri (Persero) Tbk (BMRI)	67
4.12 Bumi Serpong Damai Tbk (BSDE)	68
4.13 Charoen Pokphand Indonesia Tbk (CPIN)	69
4.14 Gudang Garam Tbk (GGRM)	70
4.15 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk (ICBP)	71
4.16 Indofood Sukses Makmur Tbk (INDF)	72
4.17 Indo cement Tunggal Prakarsa Tbk (INTP)	73
4.18 Kalbe Farma Tbk (KLBF)	74
4.19 Lippo Karawaci Tbk (LPKR)	75
4.20 Matahari Department Store Tbk (LPPF)	77
4.21 Media Nusantara Citra Tbk (MNC)	78
4.22 Matahari Putra Prima Tbk (MPPA)	78
4.23 Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk (PGAS)	89
4.24 Pakuwon Jati Tbk (PWON)	80
4.25 Surya Citra Media Tbk (SCMA)	81
4.26 Semen Indonesia (Persero) Tbk (SMGR)	82
4.27 Summarecon Agung Tbk (SMRA)	83
4.28 Sawit Sumbermas Sarana Tbk (SSMS)	84
4.29 Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk	85
4.30 United Tractors Tbk (UNTR)	86
4.31 Unilever Indonesia Tbk (UNVR)	87
4.32 Wijaya Karya (Persero) Tbk (WIKA)	88



BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	90
5.1 Statistik deskriptif	93
5.2 Hasil Uji Asumsi Klasik.....	95
5.2.1 Uji Normalitas	95
5.3 Hasil Regresi Linear Berganda	100
5.4 Pengujian Hipotesis.....	102
5.6.1 Uji Statistik T (uji t)	102
5.5 Pengujian Hipotesis 2.....	104
5.7.1 Uji <i>Paired T-Test</i>	104
5.6 Interpretasi Hasil.....	106
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN.....	108
6.1 Kesimpulan	108
6.3 Keterbatasan Penelitian.....	108
6.2 Saran.....	109

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak meugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.