**DAFTAR** **ISI**

ABSTRAK i

ABSTRACT ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI v

DAFTAR TABEL viii

DAFTAR GAMBAR ix

DAFTAR LAMPIRAN…………………………………………………….. x

BAB I: PENDAHULUAN

1. Latar Belakang Masalah 1
2. Identifikasi Masalah 5
3. Batasan Masalah 6
4. Batasan Penelitian 6
5. Rumusan Masalah 6
6. Tujuan Penelitian .. 7
7. Manfaat Penelitian 7

BAB II: KAJIAN PUSTAKA

1. Landasan Teoritis 9

1. Hipotesis Pasar Efisien……………...…………………...…………………………9

a. Definisi………………………………………………………………………… 9

b. Bentuk-bentuk Pasar Efisien…………………………………………………....11

2. Anomali Pasar…………………………………………………………………… .14

a. Definisi dan Konsep Anomali Pasar 14

b. Jenis-Jenis Anomali Pasar ………..……………………………………………15

3. *Day of the Week Effect* (Pengaruh Hari Perdagangan)…………………………. 18

4. *Week-Four Effect* (Pengaruh Minggu Ke-empat) …….………………………...19

5. *Rogalsky Effect* (Pengaruh Rogalski) …….……………………………………. 20

6. *Behavioral Finance* (Perilaku Keuangan) ..……………………………………. 21

7. *Return* Saham..………………………………......................................................22

a. Definisi………………………………………………………………………... 22

b. Jenis-jenis *return* saham………………………………………………………. 23

c. Komponen-komponen Return……………………………………………….... 23

d. Penghitungan *Return* Saham………………………………………….............. 23

1. Penelitian Terdahulu………………………………………………………………..…28
2. Kerangka Pemikiran………………………………………………………….............. 31
3. Hipotesis………………………………….................................................................... 32

BAB III: METODE PENELITIAN

1. Obyek Penelitian……………………………………………………………………... . 33
2. Disain Penelitian…………………………………...…………………………………. 34
3. Variabel Penelitian ………………………………...…………………………………. 34
4. Teknik Pengambilan Sampel………………………………………………………..... 37
5. Teknik Pengumpulan Data…………………………………………………………… 38
6. Teknik Analisis Data………………………………………………………………… 39

1. Uji Analisis Deskriptif………………………………………………………… 40

2. Uji Model (Uji Normalitas)…………………………………………………….40

3. Uji ANOVA…………………………………………………………………… 41

4. Uji *Kruskal-Wallis*……………………………………………………………...41

5. Uji Beda *Paired T-Test*…………………………………………………............42

6. Uji *Wilcoxon* (*signed rank test*)...………………………………………………42

BAB IV: HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN

1. Gambaran Umum Obyek Penelitian…….…………………………………………….44
2. Analisis Deskriptif………………………………………………………………...…..48
3. Hasil Penelitian………………………………………………………………………..54
4. Pembahasan…………………………………………………………………………... 61

BAB V: KESIMPULAN DAN SARAN

1. Kesimpulan………………………………………………………………....................75
2. Saran……………………………………………………………….. 76

DAFTAR PUSTAKA…………………………………………………………………… 78

LAMPIRAN...........................................................................................................………… ....82