# DAFTAR ISI

[**ABSTRAK i**](#_Toc21355251)

[**ABSTRACT ii**](#_Toc21355252)

[**KATA PENGANTAR iii**](#_Toc21355253)

[**DAFTAR ISI v**](#_Toc21355254)

[**DAFTAR TABEL vii**](#_Toc21355255)

[**DAFTAR GAMBAR viii**](#_Toc21355256)

[**DAFTAR GRAFIK ix**](#_Toc21355257)

[**DAFTAR LAMPIRAN x**](#_Toc21355258)

[**BAB I 1**](#_Toc21355259)

[**PENDAHULUAN 1**](#_Toc21355260)

[**A. Latar Belakang Masalah 1**](#_Toc21355261)

[**B. Indentifikasi Masalah 6**](#_Toc21355262)

[**C. Batasan Masalah 7**](#_Toc21355263)

[**D. Batasan Penelitian 7**](#_Toc21355264)

[**E. Tujuan Penelitian 7**](#_Toc21355265)

[**F. Manfaat Penelitian 8**](#_Toc21355266)

[**BAB II 9**](#_Toc21355267)

[**KAJIAN PUSTAKA 9**](#_Toc21355268)

[**A. Landasan Teoritis 9**](#_Toc21355269)

[1. Hipotesis Pasar Efisien (*Efficient Market Hypothesis*) 9](#_Toc21355270)

[2. Anomali Pasar 12](#_Toc21355271)

[3. *The Day of The Week Effect* (Pengaruh Hari Perdagangan) 14](#_Toc21355272)

[4. *Week Four Effect* (Pengaruh Minggu Keempat) 15](#_Toc21355273)

[5. *Return* Saham 16](#_Toc21355274)

[*6.* Abnormal *Return* 19](#_Toc21355275)

[**B. Penelitian Terdahulu 21**](#_Toc21355276)

[**C. Kerangka Pemikiran 26**](#_Toc21355277)

[**D. Hipotesis 28**](#_Toc21355278)

[**BAB III 29**](#_Toc21355279)

[**METODE PENELITIAN 29**](#_Toc21355280)

[**A. Objek Penelitian 29**](#_Toc21355281)

[**B. Disain Penelitian 29**](#_Toc21355282)

[**C. Variabel Penelitian 30**](#_Toc21355283)

[**D. Teknik Pengumpulan Data 33**](#_Toc21355284)

[**E. Teknik Pengambilan Sampel 33**](#_Toc21355285)

[**F. Teknik Analisis Data 34**](#_Toc21355286)

[**BAB 1V 38**](#_Toc21355287)

[**HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN 38**](#_Toc21355288)

[**A. Gambaran Umum Objek Penelitian 38**](#_Toc21355289)

[**B. Analisis Deskriptif 41**](#_Toc21355290)

[**C. Hasil Penelitian 43**](#_Toc21355291)

[**D. Pembahasan 47**](#_Toc21355292)

[1. Pengujian *The Day of The Week Effect* terhadap *Return* Saham 47](#_Toc21355293)

[2. Pengujian *Week Four Effect* terhadap *Return* Saham 50](#_Toc21355294)

[**BAB V 52**](#_Toc21355295)

[**KESIMPULAN DAN SARAN 52**](#_Toc21355296)

[**A. KESIMPULAN 52**](#_Toc21355297)

[**B. SARAN 52**](#_Toc21355298)

[**DAFTAR PUSTAKA 53**](#_Toc21355299)

[**LAMPIRAN 56**](#_Toc21355300)