**DAFTAR ISI**

**COVER** i

**LEMBAR PENGESAHAN** ii

**ABSTRAK** iii

***ABSTRACT*** iv

**KATA PENGANTAR** v

**DAFTAR ISI** vii

**DAFTAR GAMBAR** xi

**DAFTAR TABEL** xii

**BAB I PENDAHULUAN** 1

**A.** **Latar Belakang Masalah** 1

**B.** **Identifikasi Masalah** 9

**C.** **Batasan Penelitian** 9

**D.** **Tujuan Penelitian** 10

**E.** **Manfaat Penelitian** 10

**BAB II LANDASAN TEORI** 11

**A.** **Landasan Teoritis** 11

1. Investasi 11

a. Pengertian Investasi 11

b. Tujuan Investasi 12

c. Bentuk-bentuk investasi 13

2. Pasar Modal 13

a. Pengertian pasar modal 13

b. Jenis-jenis Investasi yang umum di Pasar Modal 14

3. Indeks Harga Saham 19

a. Indeks Harga Saham Gabungan 19

b. Indeks LQ45 20

4. Pasar Efisien 20

a. Definisi Pasar Efisien 20

b. Bentuk Hipotesis Efisiensi Pasar 22

c. Alasan-alasan Pasar yang Efisien dan tidak Efisien 24

5. Anomali Pasar 26

a. Anomali Perusahaan *(Firm Anomalies)* 26

b. Anomali Musiman *(Seasonal Anomaly)* 26

c. Anomali Peristiwa 27

d. Anomali Akuntansi *(Accounting Anomaly)* 27

6. *The Day of The Week Effect* 28

a. *Monday Effect* 28

7. Efek Minggu Keempat (*Week Four Effect*) 28

8. *Teori Behavioral Finance* 29

a. Awal *Behavioral Finance* 29

b. Pengertian *Behavioral Finance* 30

**B.** **Ringkasan** **Penelitian Terdahulu** 31

**C.** **Kerangka Penelitian** 34

1. Pengaruh *The Day of The Week Effect* terhadap *return* saham 35

2. Pengaruh *Week Four Effect* terhadap *return* saham 35

**D.** **Hipotesis Penelitian** 37

**BAB III METODE PENELITIAN** 38

**A.** **Obyek penelitian** 38

**B.** **Disain Penelitian** 38

**C.** **Variabel Penelitian** 39

1. Variabel Dependen (variabel terikat) 39

2. Variabel Independen (variabel bebas) 40

a. *The Day of The week Effect* 40

b. *Week Four Effect* 41

**D.** **Teknik Pengumpulan data** 42

**E.** **Teknik pengambilan Sampel** 42

**F.** **Pengolahan data dan Analisis Data** 43

1. Analisis Deksriptif 43

2. Uji normalitas 44

3. Pengujian Hipotesis 1 44

4. Pengujian Hipotesis 2 45

**BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN** 46

**A.** **Gambaran Umum Obyek Penelitian** 46

**B.** **Analisis Deskriptif** 47

**C.** **Hasil Penelitian** 51

1. Uji Normalitas 51

2. Hasil Pengujian Variabel *The Day of The Week Effect* 53

3. Hasil Pengujian *Week Four Effect* 53

**D.** **Pembahasan** 55

1. Pembahasan Hasil Penelitian *The Day of The Week Effect* 55

2. Pembahasan Hasil Penelitian *Week Four Effect* 59

**BAB V KESIMPULAN DAN SARAN** 61

**A.** **Kesimpulan** 61

**B.** **Saran** 61

**Daftar Pustaka** 64

**LAMPIRAN** 68