

DAFTAR ISI

Halaman Sampul	i
Judul	ii
Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Persetujuan	iv
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xi
Daftar Lampiran	xii
Abstrak	xiii
Abstract	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Sistematika Penulisan	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA	9
2.1 Pasar Modal	9
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	9
2.2 Investasi	10
2.3 Pasar Efisien	12
2.4 Psikologi Investor	16
2.5 Anomali Pasar.....	20
2.5.1 The Day Of The Week Effect	22
2.5.2 Monday Effect	23
2.5.3 Weekfour Effect	24
2.5.4 Weekend Effect	25
2.6 Return Saham	26
2.7 Penelitian Terdahulu	28
2.8 Pengembangan Hipotesis.....	29

BAB III METODE PENELITIAN	34
3.1 Populasi dan Sampel Penelitian	34
3.2 Jenis dan Sumber Data.....	35
3.3 Definisi Operasional Variabel dan Pengukurannya.....	35
3.4 Metode Analisis Data	38
3.5 Pengolahan Data Awal	38
3.6 Pengujian Hipotesis	39
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	42
4.1 Analisis Statistik Deskriptif	42
4.2 Pengujian Hipotesis Pertama	44
4.3 Pengujian Hipotesis Kedua.....	47
4.4 Pengujian Hipotesis Ketiga.....	49
4.5 Pembahasan	50
4.5.1 Fenomena Monday Effect	50
4.5.2 Fenomena Weekfour Effect	52
4.5.3 Fenomena Weekend Effect.....	54
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	58
5.1 Kesimpulan	58
5.2 Saran	59
DAFTAR PUSTAKA	60
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

4.1. Rata – Rata Return Saham Harian 2017	42
4.2. Test of Homogeneity of Variances	45
4.3. Rata – Rata Return Saham Harian Tahun 2017	45
4.4. Hasil Pengujian Fenomena Monday Effect Dengan Uji Anova	46
4.5. Rata – Rata Return Minggu 1 – 4 Tahun 2012	47
4.6. Hasil Pengujian Fenemena Weekfour Effect Dengan Uji One Sample Test	48

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Harga Saham	65
Lampiran 2 Return Saham	122
Lampiran 3 Return Minggu 1 – 4	177
Lampiran 4 Hasil Olah Data	178