**ABSTRAK**

Di dalam teori pasar efisien disebutkan bahwa pada pasar efisien bentuk lemah, investor tidak menggunakan informasi masa lalu untuk memprediksi nilai di masa sekarang. Hal ini berkaitan dengan teori langkah acak (*random walk*). Sementara itu, anomali pasar merupakan hal yang tampaknya bertentangan dengan teori pasar efisien. Salah satu anomali pasar yang menarik untuk diteliti adalah anomali kalender yaitu *the day of the week effect, week four effect, rogalsky effect* dan juga anomali perusahaan yaitu *size effect*.

Penelitian ini dilakukan dengan tujuan untuk menguji ada atau tidaknya keberadaan *the day of the week effect, week four effect, rogalsky effect* dan *size effect* pada *return* saham pada Perusahaan yang Tergabung dalam Kelompok Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia.

Jenis data yang digunakan adalah data sekunder dengan sumber data berupa harga saham penutupan harian dari saham Perusahaan yang Tergabung dalam Kelompok Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia. Data bersifat *time series*  yaitu data suatu objek yang terdiri atas beberapa periode. Sedangkan periode yang digunakan adalah Januari – Desember 2014.

Pengujian hipotesis dilakukan dengan menggunakan analisis uji beda rata-rata menggunakan *paired sampel t-test* dan uji *wilcoxson.* Pengolahan data dibantu dengan menggunakan *software SPSS v.21.*

Berdasarkan hasil penelitian yang dilakukan, diperoleh bahwa tidak terdapat perbedaan yang signifikan *return* saham *the day of the week effect* dan terdapat perbedaan yang signifikan *return* saham *week four effect, rogalsky effect* dan *size effect* pada Perusahaan yang Tergabung dalam Kelompok Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci: *Efficient Market Hypothesis, the day of the week effect, week four effect, rogalsky effect* dan *size effect.*

***ABSTRACT***

*In the efficient market theory states that the weak form efficient market, investors do not use past information to predict the values ​​in the present. This relates to the random walk theory (random walk). Meanwhile, the market is an anomaly that seems to contradict the efficient market theory. One anomaly attractive market for the calendar anomaly observed is that the day of the week effect, week four effect, rogalsky effects and anomalies that company size effect.*

*This research was conducted in order to test whether or not the presence of the day of the week effect, week four effect, rogalsky effect and size effect on stock returns in the Company Drawn in Group LQ45 index in the Indonesia Stock Exchange.*

*The data used is secondary data with the source data such as the daily closing share price of the Company's shares in the Merged Group LQ45 index in the Indonesia Stock Exchange. The data is time series data is an object consisting of several periods. While the period used is from January to December, 2014.*

*Hypothesis testing is done by using different test analysis on average using paired samples t-test and test wilcoxson. Assisted with data processing using SPSS software V.21.*

*Based on the results of research conducted, it was found that there was no significant difference return stock the day of the week effects and there are significant differences of stock return week four effect, rogalsky effect and size effect on the Company's Drawn in Group LQ45 index in the Indonesia Stock Exchange.*

*Keywords: Efficient Market Hypothesis, the day of the week effect, week four effect, rogalsky effect and size effect.*