

DAFTAR ISI

PERSETUJUAN SKRIPSI	i
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
ABSTRACT.....	v
ABSTRAK.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	13
1.3.1 Tujuan Penelitian	13
1.3.2 Kegunaan Penelitian.....	14
1.4 Sistematika Penulisan.....	15
BAB II TELAAH PUSTAKA	17
2.1 Landasan Teori	17
2.1.1 Teori Pasar Efisien	17
2.1.2 Anomali Pasar	18
2.1.3 Efek Hari Perdagangan	20
2.1.4 <i>Monday Effect</i>	21
2.1.5 Bursa Efek.....	22
2.1.6 <i>Return</i>	23
2.1.7 Investor.....	25
2.1.8 Volume.....	26
2.2 Penelitian Terdahulu.....	27
2.3 Pengaruh Hubungan Antar Variabel	52
2.3.1 Pengaruh Hari Senin terhadap <i>Return</i>	52

2.3.2	Pengaruh Hari Senin terhadap Total Volume Transaksi Investor...	53
2.3.3	Pengaruh Hari Senin terhadap Pola Transaksi Investor.....	54
2.4	Kerangka Pemikiran	55
2.5	Hipotesis	56
BAB III METODE PENELITIAN.....		58
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	58
3.1.1	Variabel Dependen.....	58
3.1.1.1	Rata-Rata <i>Return</i> Harian.....	58
3.1.1.2	Rata-Rata Volume Transaksi Harian	59
3.1.1.3	Pola Transaksi Investor.....	59
3.1.2	Variabel Independen	60
3.2	Populasi dan Sampel	62
3.2.1	Populasi.....	62
3.2.2	Sampel.....	62
3.3	Jenis dan Sumber Data	63
3.4	Metode Pengumpulan Data	63
3.5	Metode Analisis Data	63
3.5.1	Statistik Deskriptif	64
3.5.2	Uji Normalitas.....	64
3.5.3	Uji Homogenitas	65
3.5.4	Uji ANOVA	65
3.5.5	<i>Post Hoc Test</i>	66
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....		67
4.1	Deskripsi Objek Penelitian.....	67
4.2	Hasil Analisis Data.....	67
4.2.1	Statistik Deskriptif	67
4.2.1.1	<i>Return</i> Harian.....	67
4.2.1.2	Volume Transaksi Harian	69
4.2.1.3	<i>Return</i> Harian Interval 30 Menit.....	70
4.2.2	Uji Asumsi Normalitas.....	77
4.2.2.1	Uji Normalitas <i>Return</i> Harian.....	78
4.2.2.2	Uji Normalitas Volume Transaksi Harian	84

4.2.2.3	Uji Normallitas <i>Return</i> Interval 30 Menit.....	90
4.2.3	Uji Asumsi Homogenitas Levene	92
4.2.3.1	<i>Return</i> Harian.....	92
4.2.3.2	Volume Transaksi Harian	93
4.2.3.3	<i>Return</i> Interval 30 Menit.....	94
4.2.4	Uji ANOVA	97
4.2.4.1	Uji ANOVA <i>Return</i> Harian	97
4.2.4.2	Uji ANOVA Volume Transaksi Harian.....	98
4.2.4.3	Uji ANOVA <i>Return</i> Interval 30 Menit.....	100
4.3	Pengujian Hipotesis	117
4.4	Interpretasi Hasil	121
4.4.1	Perbedaan pada Rata-Rata <i>Return</i> antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Sebelum Pandemi.....	121
4.4.2	Perbedaan pada Rata-Rata <i>Return</i> antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Selama Pandemi.....	123
4.4.3	Perbedaan pada Rata-Rata Total Volume Transaksi Harian antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Sebelum Pandemi.....	124
4.4.4	Perbedaan pada Rata-Rata Total Volume Transaksi Harian antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Selama Pandemi.....	126
4.4.5	Perbedaan pada Pola Transaksi Investor per 30 Menit antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Sebelum Pandemi.....	128
4.4.6	Perbedaan pada Pola Transaksi Investor per 30 Menit antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Selama Pandemi Sebelum Perubahan Jam Perdagangan	130
4.4.7	Perbedaan pada Pola Transaksi Investor per 30 Menit antara Hari Senin dengan Hari Perdagangan Lainnya Selama Pandemi Sebelum Perubahan Jam Perdagangan	133
BAB V PENUTUP.....		136
5.1	Kesimpulan.....	136
5.2	Keterbatasan Penelitian	138
5.3	Saran.....	139
5.3.1	Saran bagi Investor.....	139
5.3.2	Saran bagi Penelitian Selanjutnya.....	140
5.3.3	Saran bagi Regulator	141

DAFTAR PUSTAKA	142
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	148