

DAFTAR ISI

MOTTO	i
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	ii
ABSTRAK	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR SINGKATAN.....	xii
DAFTAR SIMBOL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah	11
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.4 Kegunaan Penelitian.....	12
1.4.1 Kegunaan Teoritis	12
1.4.2 Kegunaan Praktis	13
1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	13
1.5.1 Lokasi Penelitian.....	13
1.5.2 Waktu Penelitian	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	
2.1 Tinjauan Pustaka	15
2.1.1 <i>January effect</i>	15
2.1.1.1 Sejarah <i>January effect</i>	15
2.1.1.2 Definisi <i>January effect</i>	16
2.1.1.3 Penyebab Terjadinya <i>January effect</i>	17
2.1.2 <i>Monday effect</i>	19

2.1.2.1	Definisi <i>Monday effect</i>	19
2.1.2.2	Penyebab Terjadinya <i>Monday effect</i>	20
2.1.3	<i>Weekend effect</i>	21
2.1.3.1	Definisi <i>Weekend effect</i>	21
2.1.3.2	Penyebab Terjadinya <i>Weekend effect</i>	22
2.1.4	<i>Return Saham</i>	23
2.1.4.1	Definisi <i>Return Saham</i>	23
2.1.4.2	Jenis-Jenis <i>Return Saham</i>	25
2.1.5	Anomali Pasar Modal.....	29
2.1.5.1	Perkembangan Teknologi Informasi dalam Analisis Anomali Pasar Modal.....	32
2.2	Kajian Empiris.....	34
2.3	Kerangka Pemikiran	46
2.4	Hipotesis	51

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1	Objek Penelitian	53
3.2	Metode Penelitian.....	53
3.2.1	Jenis Penelitian.....	55
3.2.2	Operasionalisasi Variabel.....	55
3.2.3	Teknik Pengumpulan Data.....	57
3.2.3.1	Jenis dan Sumber Data	57
3.2.3.2	Populasi.....	58
3.2.3.3	Penentuan Ukuran Sampel Penelitian	60
3.2.3.4	Prosedur Pengumpulan Data	62
3.3	Model Penelitian.....	63
3.4	Teknik Analisis Data	63
3.4.1	Uji Statistik Deskriptif	64
3.4.2	Uji Normalitas.....	65
3.4.3	Uji Hipotesis	65
3.4.3.1	Hipotesis Operasional	65
3.4.3.2	Penetapan Tingkat.....	66
3.4.3.3	Uji Beda	67

3.4.3.4	Kaidah Keputusan	68
3.4.3.5	Penarikan Kesimpulan	68
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		
4.1	Hasil Penelitian.....	69
4.1.1	Deskripsi Data Penelitian	70
4.1.1.1	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah January effect</i>	70
4.1.1.2	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Monday effect</i>	73
4.1.1.3	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Weekend effect</i>	76
4.1.2	Analisis Data Penelitian	79
4.1.2.1	Analisis Uji Statistik Deskriptif	79
4.1.2.1.1	Analisis Uji Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah January effect</i>	79
4.1.2.1.2	Analisis Uji Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Monday effect</i>	81
4.1.2.1.3	Analisis Uji Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Weekend effect</i>	83
4.1.2.2	Analisis Uji Normalitas.....	84
4.1.2.3	Analisis Uji Beda	87
4.1.2.3.1	Analisis Uji Beda <i>Return Saham January effect</i>	88
4.1.2.3.2	Analisis Uji Beda <i>Return Saham Monday effect</i>	89
4.1.2.3.3	Analisis Uji Beda <i>Return Saham Weekend effect</i>	90
4.2	Pembahasan	92
4.2.1	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah January effect</i>	92
4.2.2	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Monday effect</i>	97
4.2.3	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Weekend effect</i>	100
BAB V SIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Simpulan.....	104
5.2	Saran	105
DAFTAR PUSTAKA		107
LAMPIRAN.....		112
BIODATA PENULIS.....		144

DAFTAR TABEL

Nomor	Judul	Halaman
2.1	Persamaan dan Perbedaan Penelitian Terdahulu dengan Penelitian Penulis.....	40
3.1	Operasionalisasi Variabel.....	56
3.2	Populasi Penelitian.....	58
3.3	Kriteria Penentuan Ukuran Sampel Penelitian.....	61
3.4	Sampel Penelitian Perusahaan yang Terdaftar di indeks IDX30 Tahun 2019-2024.....	61
4.1	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah January effect</i>	71
4.2	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Monday effect</i>	74
4.3	<i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Weekend effect</i>	77
4.4	Hasil Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah January effect</i>	80
4.5	Hasil Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Monday effect</i>	82
4.6	Hasil Statistik Deskriptif <i>Return Saham Sebelum dan Sesudah Weekend effect</i>	83
4.7	Hasil Uji Normalitas Data.....	86
4.8	Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Return Saham January effect</i>	88
4.9	Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Return Saham Monday effect</i>	90
4.10	Hasil Uji <i>Wilcoxon Signed Rank Test Return Saham Weekend effect</i>	91

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Judul	Halaman
1.1	Pertumbuhan Investor.....	1
1.2	<i>Return</i> Saham Januari dan Desember 2018-2022.....	5
1.3	Rata-rata <i>Return</i> Harian IDX30 Periode 2018–2022.....	8
2.1	Kerangka Penelitian.....	51
3.1	Periode Pengamatan.....	54
3.2	Model Penelitian.....	63
4.1	Rata-rata <i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>January effect</i>	92
4.2	Rata-rata <i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>Monday effect</i>	97
4.3	Rata-rata <i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>Weekend effect</i>	100

DAFTAR SINGKATAN

Nomor	Singkatan	Istilah
1	BEI	Bursa Efek Indonesia
2	KSEI	Kustodian Sentral Efek Indonesia
3	NYSE	<i>New York Stock Exchange</i>
4	IDX	<i>Indonesia Stock Exchange</i>
5	OJK	Otoritas Jasa Keuangan

DAFTAR SIMBOL

Nomor	Simbol	Istilah
1	%	Persen
2	Pt	Harga penutupan saham ke t
3	Pt-1	Harga penutupan saham ke t-1
4	α	Alpha
5	Σ	Sigma
6	X ₁	Variabel independen 1 (<i>January effect</i>)
7	X ₂	Variabel independen 2 (<i>Monday effect</i>)
8	X ₃	Variabel independen 3 (<i>Weekend effect</i>)
9	Y	Variabel dependen (<i>Return Saham</i>)

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul	Halaman
1	Waktu Penelitian.....	113
2	Proses <i>Porpusive Sampling</i>	115
3	Hasil Pengujian IBM SPSS 27.....	117
4	Perhitungan <i>Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>January effect, Monday effect,</i> <i>Weekend effect</i>	121
5	Lembar Pengesahan Proposal Skripsi.....	133
6	Lembar Rekomendasi Penguji Seminar Proposal Skripsi.....	134
7	Lembar Revisi Seminar Proposal Skripsi.....	135
8	Lembar Pengesahan Seminar Hasil Penelitian.....	137
9	Lembar Rekomendasi Penguji Seminar Hasil Penelitian.....	138
10	Lembar Revisi Seminar Hasil Penelitian.....	139
11	Lembar Pengesahan Sidang Skripsi.....	141
12	Lembar Rekomendasi Penguji Sidang Skripsi.....	142
13	Lembar Revisi Sidang Skripsi.....	143