

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Motivasi Penelitian.....	8
1.6 Kontribusi Penelitian.....	8
1.6.1 Kontribusi Literatur.....	8
1.6.2 Kontribusi Praktisi	9
1.7 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	9
1.8 Sistematika Penulisan.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 <i>Mood Seasonal Hypothesis</i>	11
2.1.2 Efek Pengulangan dan Pembalikan <i>Return</i>	12
2.1.3 <i>Return</i> Saham	13
2.1.4 Beta dan <i>Mood Beta</i>	14
2.2 Penelitian Terdahulu.....	16
2.3 Pengembangan Hipotesis	19
2.4 Kerangka Penelitian	21
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
3.1 Desain penelitian	23
3.2 Populasi dan sampel	23
3.3 Objek Penelitian	24
3.4 Definisi Operasional Variabel dan Pengukuran	24
3.4.1 Variabel Dependen.....	25
3.4.2 Variabel Independen	26
3.4.3 Variabel Kontrol.....	27
3.5 Teknik pengumpulan data	28
3.6 Teknik Analisis Data	28
3.6.1 Uji Statistik Deskriptif	29
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	29
3.6.3 Uji Hipotesis	31
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	35

4.1	Gambaran Umum	35
4.2	Analisis Statistik Deskriptif Variabel	35
4.2.1	<i>Return</i>	36
4.2.2	<i>Mood Beta</i>	37
4.2.3	Covid	38
4.2.4	Kurs	38
4.2.5	Volume Perdagangan	39
4.3	Uji Asumsi Klasik	39
4.3.1	Uji Normalitas	39
4.3.2	Uji Multikolinearitas	41
4.3.3	Uji Heterokedastisitas	41
4.3.4	Uji Autokorelasi	42
4.4	Uji Hipotesis	43
4.5	Pengujian Tambahan	46
4.6	Analisis dan Pembahasan	48
4.5.1	Terdapat Efek Pengulangan (Pembalikan) <i>Return</i> Saham Musiman pada Periode Suasana Hati Investor yang Kongruen (Tidak Kongruen)	49
4.5.2	<i>Mood beta</i> tinggi (rendah) berpengaruh positif terhadap <i>return</i> pada periode suasana hati investor baik (buruk)	50
BAB V SIMPULAN, KETERBATASAN, DAN SARAN		52
5.1	Simpulan	52
5.2	Keterbatasan dan Saran	53
DAFTAR PUSTAKA		55
LAMPIRAN		60