

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

ABSTRAK

PENGARUH MONDAY EFFECT DAN WEEKEND EFFECT TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN LQ 45

OLEH :

FITRI ANDALINA

11371206008

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh Monday effect dan weekend effect terhadap return saham pada perusahaan LQ45. Penelitian ini menggunakan data sekunder dari Bursa Efek Indonesia dengan populasi 45 perusahaan. Metode pemilihan sampel adalah purposive sampling, sehingga di peroleh sampel sebanyak 43 perusahaan LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Teknik analisis data yang digunakan adalah one sample t-test untuk H1, independent sample t-test untuk H2 dan H3, dan Uji ANOVA untuk H4. Hasil penelitian menunjukkan bahwa: (1) Terdapat perbedaan yang signifikan antara return saham harian pada hari-hari perdagangan dalam satu pekan di Bursa Efek Indonesia. (2) Terdapat Monday Effect pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia. (3) Tidak terdapat weekend effect pada perdagangan saham di Bursa Efek Indonesia. (4) Terdapat pengaruh return saham pada hari senin, selasa, rabu, kamis, jumat.

Kata Kunci : *return, Monday effect, weekend effect*