

**PENGARUH *MONDAY EFFECT* TERHADAP *RETURN SAHAM* PADA
PERUSAHAAN TELEKOMUNIKASI DI BURSA EFEK INDONESIA
TAHUN 2006 – 2009**

SKRIPSI



Disusun Oleh :

Fendy Zaenuddin Syahid

NIM : 141040189

**JURUSAN MANAJEMEN FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS PEMBANGUNAN NASIONAL "VETERAN"
YOGYAKARTA
2011**

Abstraksi

Ada anomali musiman di pasar keuangan yang disebut *Monday Effect*, yang terjadi ketika ada *Return* pasar saham secara signifikan negatif pada hari Senin. kehadiran anomali ini melanggar bentuk efisiensi pasar lemah karena return saham tidak acak, tetapi dapat diprediksi berdasarkan efek kalender tertentu.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui adanya pengaruh hari perdagangan dan *Monday Effect* di Bursa Efek Indonesia. Sampel dipilih dengan menggunakan *purposive sampling*. Sampel terdiri dari 6 perusahaan telekomunikasi yang listing di BEI selama periode 2006 – 2009.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa terjadi *Monday effect* dan *week four effect*. Tetapi penelitian ini tidak membuktikan adanya pengaruh hari jum'at minggu sebelumnya terhadap *Monday effect*.

Kata kunci : *return, Monday effect, week four effect*.